

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2021年10月12日提出
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【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】</b>	クルーズコントロール
<b>【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】</b>	1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

クルーズコントロール

（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。

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

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

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

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、3.3%(税抜3.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2021年10月13日から2022年4月11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】

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】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドでは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」に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、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

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

#### 振替受益権について

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

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

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

##### <ファンドの特色>

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

- 国内外の株式および公社債に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。
  - ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - ・国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
  - ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
  - ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
- 実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。
- 各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

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

- 資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
- 資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
- 下値目安値は、3ヵ月毎に下値目安値の改定日(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には、翌営業日。)を設け、改定日における基準価額から-2.0%の水準とします。ただし、当該水準は、委託会社の判断により今後変更する場合があります。
- 上記の運用目標は、現金等<sup>(\*\*)</sup>を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率<sup>(\*\*\*)</sup>を機動的に変更することで行います。

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

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

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

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

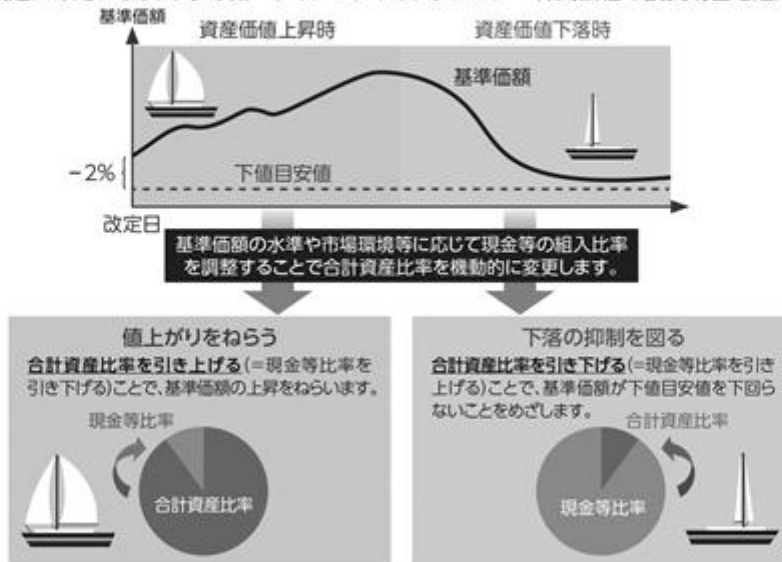
## 当ファンドの合計資産比率の変更(イメージ)

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

\*1 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

\*2 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

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



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

※ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

## ■ 分配方針

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

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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



## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

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

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

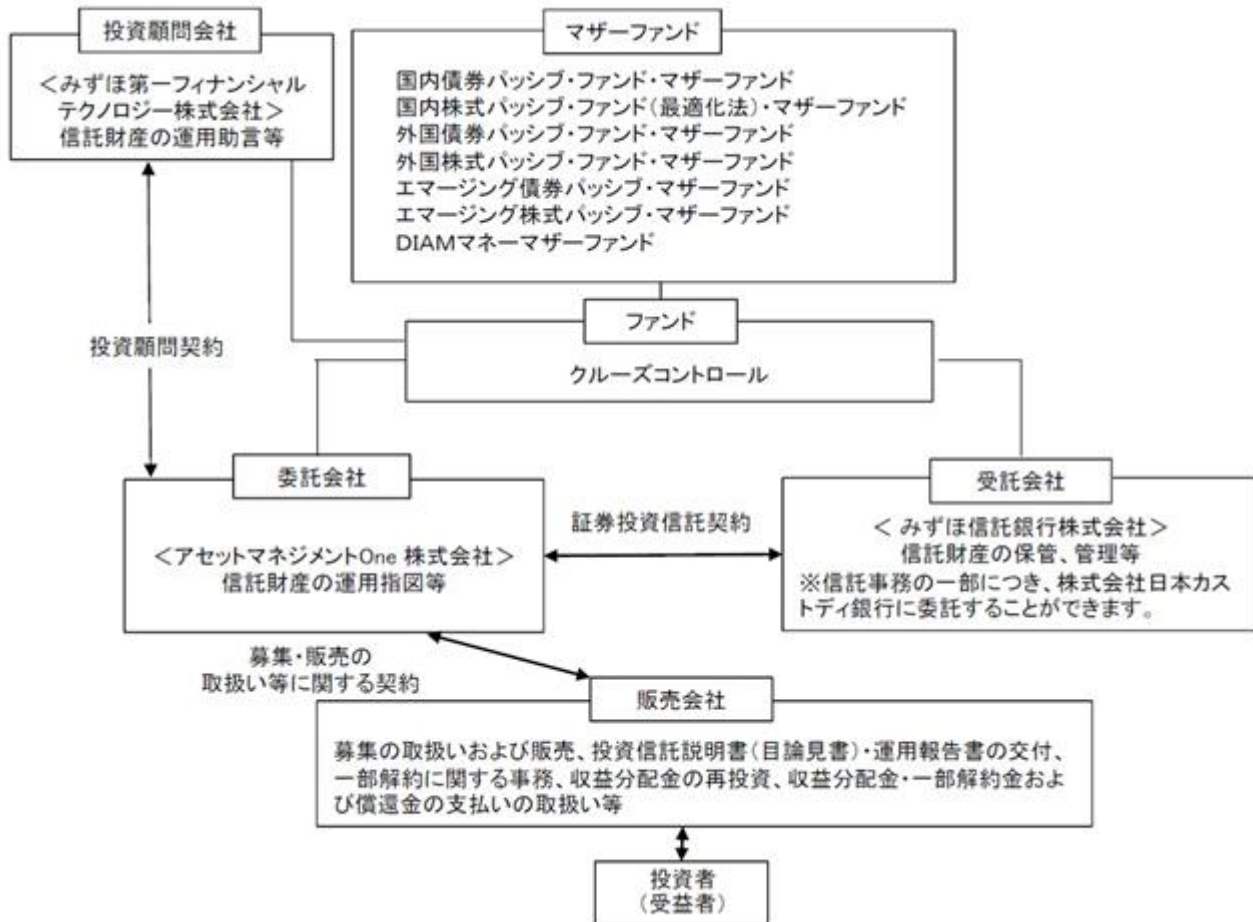
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

## （２）【ファンドの沿革】

2012年10月26日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2013年 5月17日 投資対象、投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

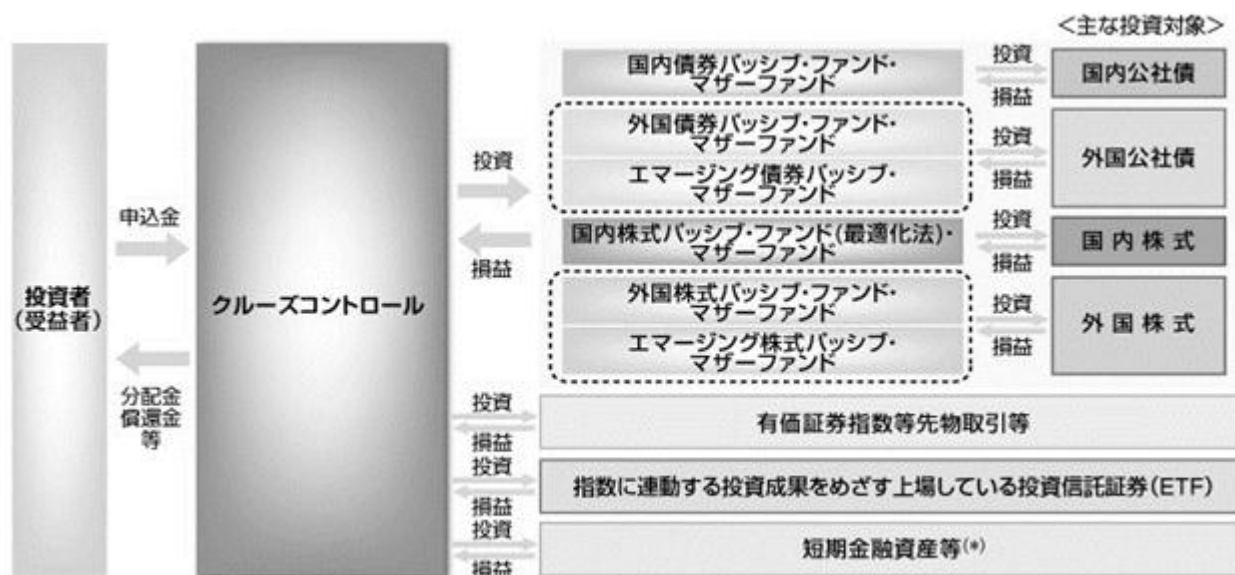
- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

## 「ファミリーファンド方式」とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



(\*)DIAMマネーマザーファンドを通じてまたは直接投資を行います。

## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2021年7月30日現在）

## 委託会社の沿革

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

## 大株主の状況

（2021年7月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

#### <投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果を目指す上場している投資信託証券（ETF）、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

#### <投資態度>

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### <運用プロセス>

##### ・基本配分比率の決定

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

##### ・下値目安値の決定

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

##### ・リバランスの実施

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

##### ・みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

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

## (2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

- a. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
- b. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうち、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)  
および新株予約権証券
  13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
  14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものを行い、振替受益権を含みます。)
  15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものを行います。)
  16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものを行います。)
  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号で定めるものを行い、有価証券にかかるものに限りませう。)
  18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものを行います。)
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りませう。)
  21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものを行います。)
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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



## (参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"><p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p></div>

<p>運用プロセス</p>	<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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 年限構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン、償還再投資</li> </ul>
---------------	---

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
--------	---

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	東京証券取引所第1部に上場されている株式 <sup>*</sup> を主要投資対象とします。

## 投資態度

- 1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式<sup>\*</sup>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。

\* 東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年4月4日に「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「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」に変更を行う予定です。

東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)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TOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、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TOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、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、株東京証券取引所は、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。

当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンド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、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、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

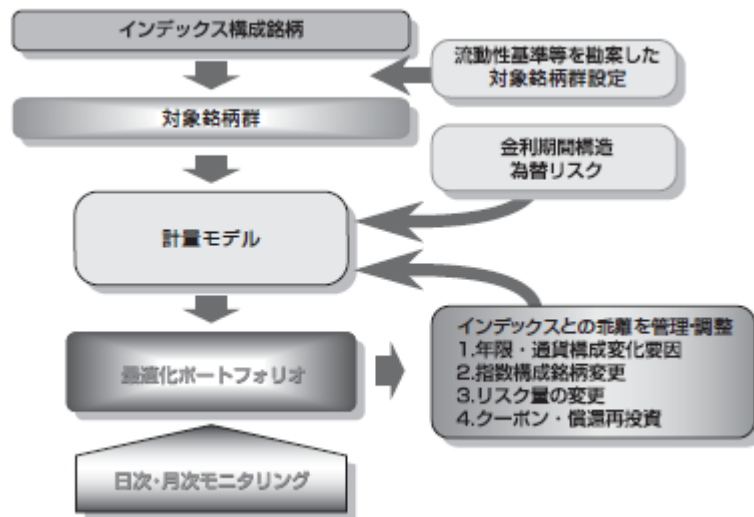
東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

<p>運用プロセス</p>	<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"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul>
<p>主な投資制限</p>	<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	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<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、為替ヘッジなし）」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。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

運用プロセス

- 1.流動性基準等による対象銘柄群設定  
 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。
- 2.最適化法によるポートフォリオの構築  
 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。
- 3.インデックスとの乖離を管理  
 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。  
 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。
  - ・ 年限・通貨構成変化要因
  - ・ 指数構成銘柄変更
  - ・ リスク量の変更
  - ・ クーポン・償還再投資





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

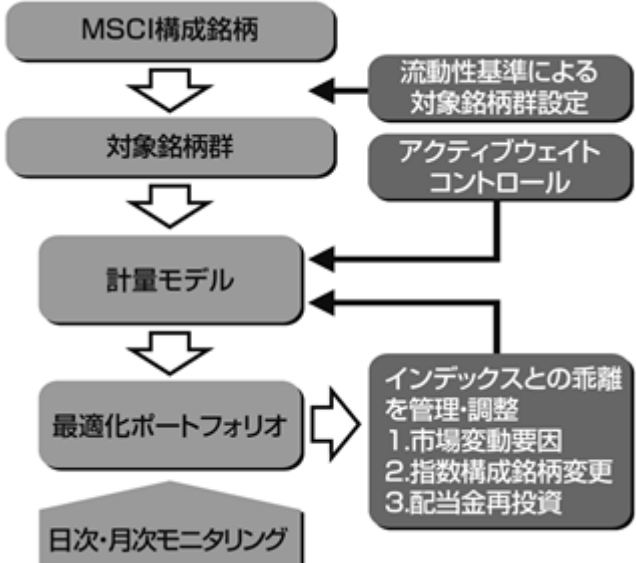
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>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。</li><li>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。</li><li>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。</li></ol>
------	--

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、

	<p>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>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。</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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; D     D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     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] --&gt; F     F --&gt; H[日次・月次モニタリング]   </pre>

<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
---------------	--

<p>ファンド名</p>	<p>エマージング債券パッシブ・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>新興国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>3. 組入債券は、当初組入時において、S&amp;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、当該ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</li> <li>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。</li> </ol> <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] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]     F[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     G[金利期間構造] --&gt; C     H["インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資"] --&gt; D   </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

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<sup>(*)</sup>に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</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。

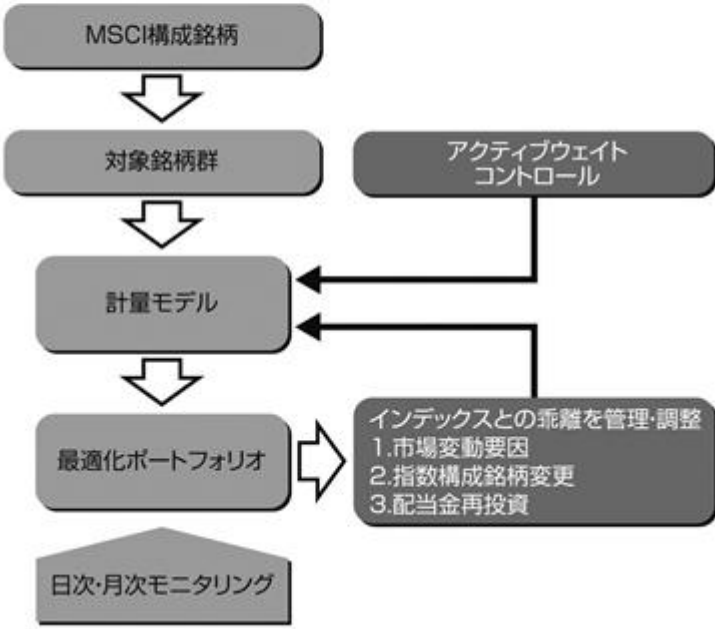
投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</li><li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li></ol>
------	---

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、



	<p>事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     D[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     D --&gt; E[最適化ポートフォリオ]     C --&gt; E     E --&gt; F[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資]     G[日次・月次モニタリング] --&gt; E   </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

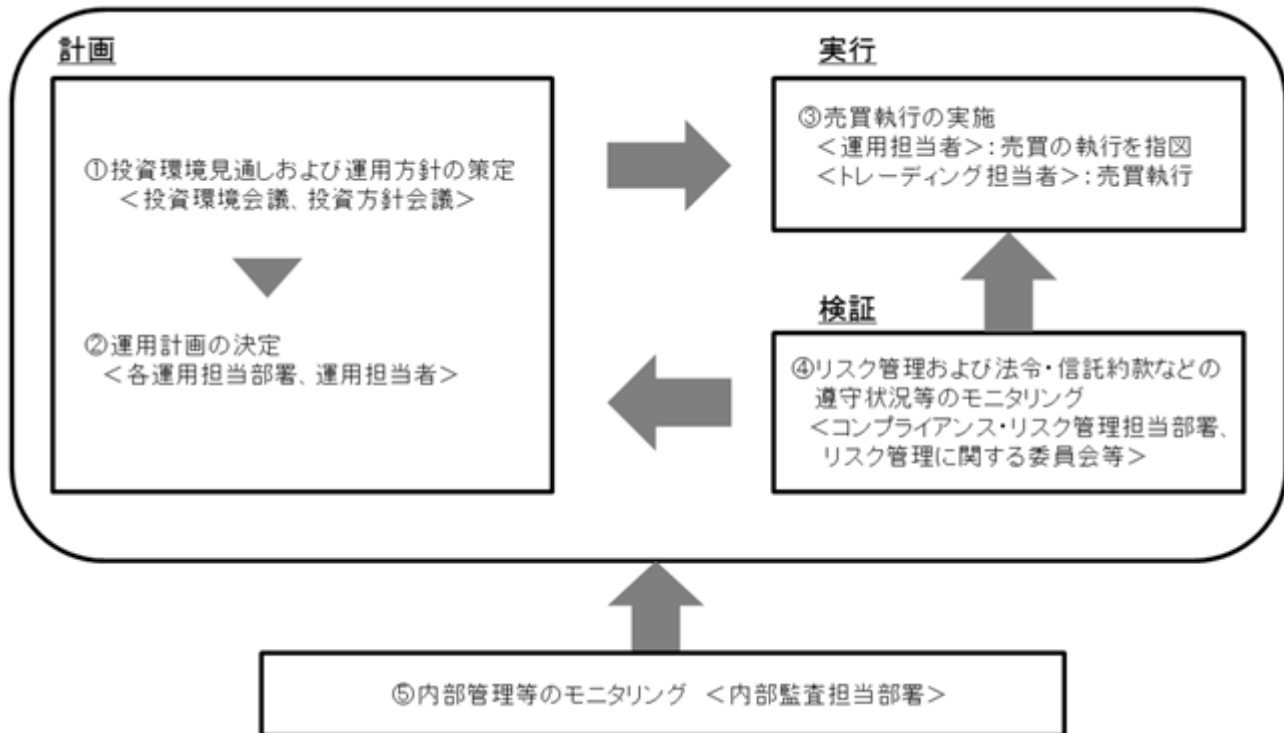
ファンド名	D I A M マネー マザー ファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

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<sup>(*)</sup>の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R&amp;I、JCR、Moody's、S&amp;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。

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

当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2021年7月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### （４）【分配方針】

#### 収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

##### (1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### (2) 分配対象額についての分配方針

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

##### (3) 留保益の運用方針

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

#### 収益の分配方式

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

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

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

#### 収益分配金の支払い

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

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

#### (5) 【投資制限】

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

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)

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

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)

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

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。

#### 信用取引の指図および範囲（約款第21条）

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

#### 先物取引等の運用指図（約款第22条）

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

#### スワップ取引の運用指図（約款第23条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、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24条の2)

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

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25条)

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

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第26条)

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

#### 外国為替予約取引の指図(約款第27条)

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

- 2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 資金の借入れ(約款第33条)

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

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

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



### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### ・資産配分リスク

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

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

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

#### ・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・信用リスク

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

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

## ・流動性リスク

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

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

## ・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## &lt;その他の留意点&gt;

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。

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

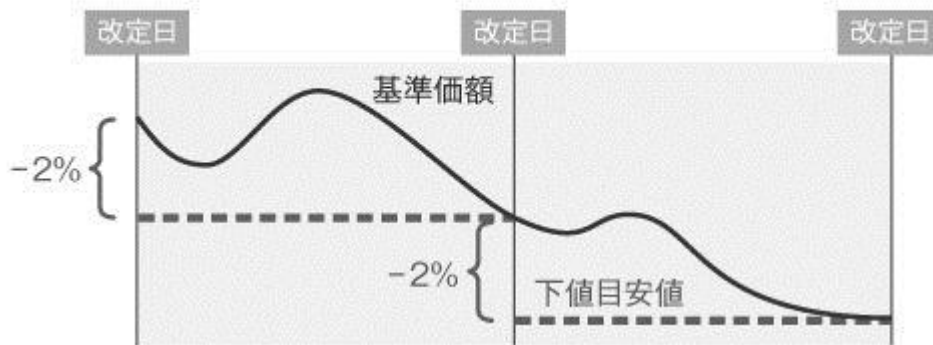
当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

<ケース> 下値目安値の切下げについて

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

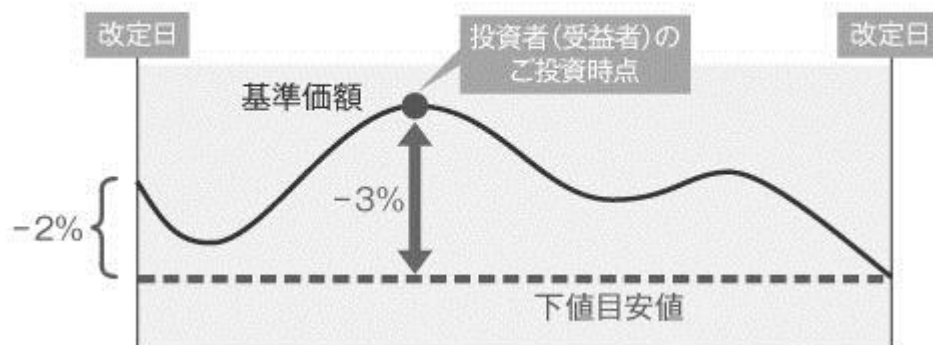
## &lt;基準価額の推移(イメージ)&gt;



## &lt;ケース&gt; 四半期中途の投資について

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

## &lt;基準価額の推移(イメージ)&gt;



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

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

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

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

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

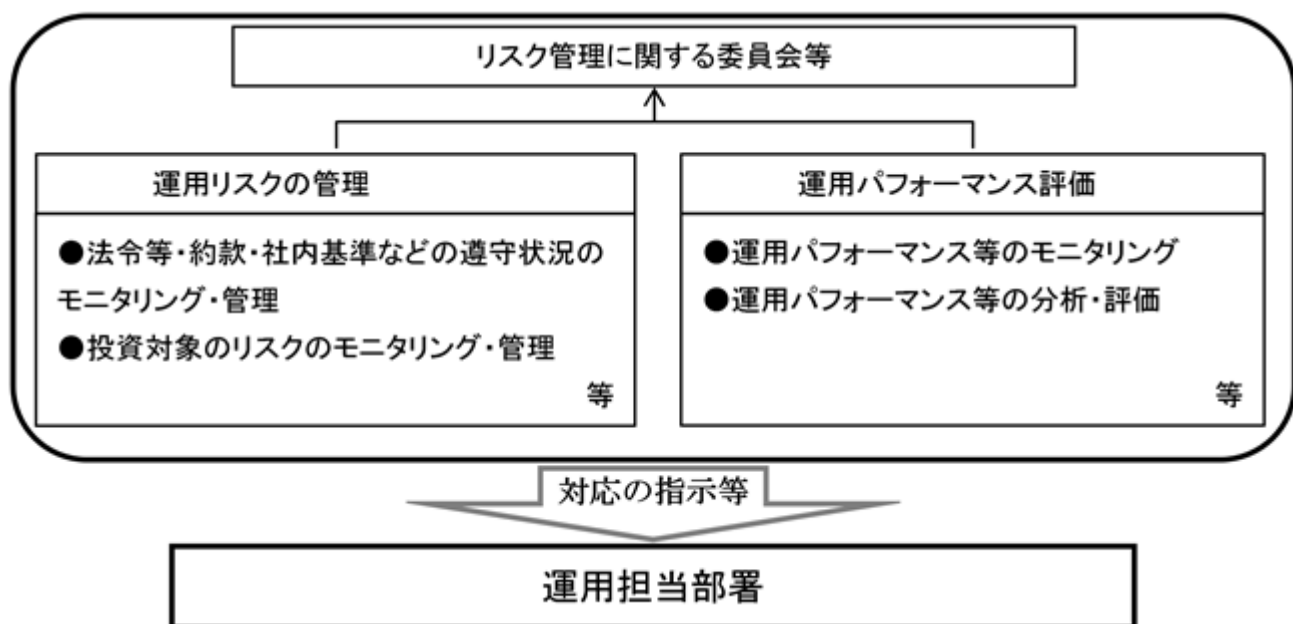
## 注意事項

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

## <リスク管理体制>

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：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、リスク管理に関する委員会等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。



リスク管理体制は2021年7月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

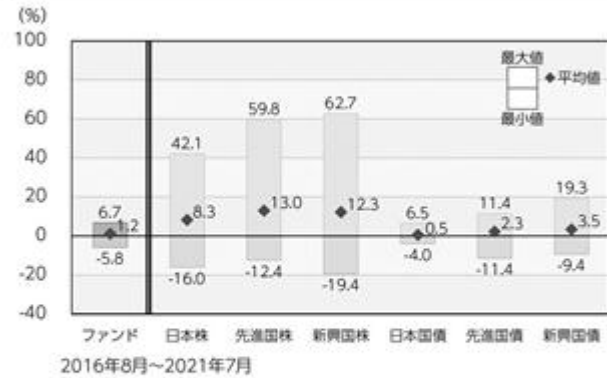
### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX)* (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数は、株式会社東京証券取引所(東京証券取引所)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は、東京証券取引所が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

\*東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.54%(税抜1.40%)

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (4)【その他の手数料等】

###### 1. 信託財産留保額

ありません。

###### 2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2021年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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

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

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



< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	7,447,568,607	55.14
内 日本	7,447,568,607	55.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,059,939,484	44.86
純資産総額	13,507,508,091	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

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	431,126,621,300	85.41
内 日本	431,126,621,300	85.41
地方債証券	27,104,973,598	5.37
内 日本	27,104,973,598	5.37
特殊債券	25,989,937,581	5.15
内 日本	25,989,937,581	5.15
社債券	19,172,771,990	3.80
内 日本	18,364,717,990	3.64
内 フランス	808,054,000	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,404,654,147	0.28
純資産総額	504,798,958,616	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

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	380,011,045,030	97.23
内 日本	380,011,045,030	97.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,820,495,389	2.77
純資産総額	390,831,540,419	100.00

#### その他資産の投資状況

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,934,700,000	2.80
内 日本	10,934,700,000	2.80

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

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

国債証券		144,404,657,387	98.85
内 アメリカ		65,392,413,190	44.76
内 フランス		14,617,953,207	10.01
内 イタリア		13,807,144,546	9.45
内 ドイツ		10,881,425,587	7.45
内 イギリス		9,449,134,398	6.47
内 スペイン		8,583,504,610	5.88
内 ベルギー		3,430,808,719	2.35
内 オーストラリア		2,934,213,564	2.01
内 オランダ		2,849,180,448	1.95
内 カナダ		2,811,267,608	1.92
内 オーストリア		2,167,376,097	1.48
内 アイルランド		1,199,369,305	0.82
内 メキシコ		1,047,613,201	0.72
内 フィンランド		897,083,029	0.61
内 ポーランド		893,302,710	0.61
内 デンマーク		722,980,794	0.49
内 イスラエル		679,909,023	0.47
内 シンガポール		636,276,255	0.44
内 マレーシア		629,430,055	0.43
内 スウェーデン		435,346,135	0.30
内 ノルウェー		338,924,906	0.23
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,680,777,351	1.15
純資産総額		146,085,434,738	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

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	562,911,224,302	95.48
内 アメリカ	391,255,565,752	66.36
内 イギリス	24,469,651,734	4.15
内 カナダ	20,429,565,037	3.47
内 スイス	19,480,845,545	3.30
内 フランス	18,878,838,866	3.20
内 ドイツ	16,659,942,391	2.83
内 オーストラリア	11,505,645,919	1.95
内 オランダ	11,234,137,642	1.91
内 アイルランド	10,649,612,742	1.81
内 スウェーデン	6,579,489,193	1.12
内 デンマーク	4,769,924,860	0.81
内 スペイン	4,397,655,109	0.75
内 香港	4,151,668,950	0.70
内 イタリア	3,296,848,758	0.56
内 フィンランド	2,370,820,939	0.40
内 ジャージー	2,321,418,864	0.39
内 シンガポール	1,627,645,242	0.28
内 ベルギー	1,494,905,528	0.25
内 バミューダ	1,342,708,026	0.23

内	ノルウェー	1,071,399,829	0.18
内	イスラエル	1,060,893,006	0.18
内	ケイマン諸島	1,029,250,696	0.17
内	ルクセンブルグ	628,557,314	0.11
内	ニュージーランド	565,257,423	0.10
内	オランダ領キュラソー	428,906,416	0.07
内	オーストリア	348,303,556	0.06
内	ポルトガル	244,189,502	0.04
内	リベリア	200,478,121	0.03
内	パナマ	188,478,056	0.03
内	マン島	161,958,938	0.03
内	パプアニューギニア	66,660,348	0.01
投資信託受益証券		1,033,238,454	0.18
内	オーストラリア	792,272,228	0.13
内	シンガポール	240,966,226	0.04
投資証券		12,174,817,688	2.07
内	アメリカ	11,240,239,957	1.91
内	イギリス	347,497,631	0.06
内	フランス	300,175,357	0.05
内	香港	215,894,025	0.04
内	カナダ	71,010,718	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		13,457,569,444	2.28
純資産総額		589,576,849,888	100.00

## その他資産の投資状況

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
株価指数先物取引(買建)	13,718,971,440	2.33	
内	アメリカ	10,192,312,420	1.73
内	ドイツ	2,129,607,952	0.36
内	イギリス	610,165,449	0.10
内	カナダ	490,493,289	0.08
内	オーストラリア	296,392,330	0.05

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

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
国債証券	152,139,102,084	98.32	
内	メキシコ	23,355,393,776	15.09
内	インドネシア	21,170,382,148	13.68
内	ロシア	19,975,485,897	12.91
内	ブラジル	16,303,752,259	10.54
内	コロンビア	14,064,792,017	9.09
内	フィリピン	13,545,073,466	8.75
内	南アフリカ	10,482,243,011	6.77
内	パナマ	9,738,162,952	6.29

内 ペルー	8,110,384,813	5.24
内 ハンガリー	6,127,443,728	3.96
内 ルーマニア	6,011,087,254	3.88
内 クロアチア	3,254,900,763	2.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,595,023,392	1.68
純資産総額	154,734,125,476	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

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	51,561,665,388	85.83
内 ケイマン諸島	11,609,517,161	19.33
内 台湾	7,343,315,889	12.22
内 韓国	7,002,270,456	11.66
内 中国	5,578,117,984	9.29
内 インド	5,523,357,645	9.19
内 ブラジル	2,708,003,588	4.51
内 南アフリカ	1,871,915,000	3.12
内 サウジアラビア	1,592,883,509	2.65
内 ロシア	1,492,900,775	2.49
内 タイ	821,883,257	1.37
内 メキシコ	705,017,867	1.17
内 マレーシア	665,381,647	1.11
内 インドネシア	618,128,761	1.03
内 香港	590,765,694	0.98
内 アラブ首長国連邦	391,127,262	0.65
内 カタール	345,275,895	0.57
内 ポーランド	340,537,179	0.57
内 バミューダ	318,705,383	0.53
内 フィリピン	302,446,910	0.50
内 クエート	296,026,245	0.49
内 チリ	225,484,550	0.38
内 アメリカ	202,262,910	0.34
内 オランダ	165,040,277	0.27
内 トルコ	143,187,460	0.24
内 ルクセンブルグ	130,169,652	0.22
内 ハンガリー	125,832,130	0.21
内 キプロス	87,803,791	0.15
内 ギリシャ	87,267,920	0.15
内 コロンビア	76,304,289	0.13
内 チェコ	58,318,625	0.10
内 ジェージア	54,498,802	0.09
内 エジプト	29,176,458	0.05
内 マン島	16,397,692	0.03
内 イギリス領バージン諸島	15,591,960	0.03
内 シンガポール	8,864,864	0.01
内 ペルー	8,524,617	0.01
内 パキスタン	7,324,087	0.01

	内 アルゼンチン	2,037,197	0.00
投資信託受益証券		394,410,401	0.66
	内 メキシコ	267,409,063	0.45
	内 ブラジル	127,001,338	0.21
投資証券		46,628,872	0.08
	内 南アフリカ	26,007,523	0.04
	内 メキシコ	20,621,349	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		8,072,110,814	13.44
純資産総額		60,074,815,475	100.00

#### その他資産の投資状況

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	8,094,427,085	13.47
内 アメリカ	8,094,427,085	13.47

(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。

#### D I A Mマネーマザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	410,549,100	39.32
内 日本	410,549,100	39.32
特殊債券	254,311,520	24.36
内 日本	254,311,520	24.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	379,316,368	36.33
純資産総額	1,044,176,988	100.00

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

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

#### (2) 【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	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	950,624,403	2.0518 1,950,493,096	2.0584 1,956,765,271	- -	14.49
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	992,846,360	1.3097 1,300,332,887	1.3125 1,303,110,847	- -	9.65
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	405,048,101	3.2023 1,297,086,465	3.1172 1,262,615,940	- -	9.35

4	D I A Mマナーマザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	990,000,991	1.0078 997,821,998	1.0079 997,821,998	- -	7.39
5	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	118,711,274	5.4479 646,727,420	5.4788 650,395,327	- -	4.82
6	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	297,838,938	2.1821 649,914,955	2.1668 645,357,410	- -	4.78
7	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	436,753,451	1.4806 646,658,106	1.4459 631,501,814	- -	4.68

(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

2021年7月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	55.14
合計	55.14

(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

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	3 2 5 回 利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 日本	国債証 券	5,700,000,000	101.28 5,772,994,000	101.05 5,760,192,000	0.8 2022/9/20	1.14
2	3 5 0 回 利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 日本	国債証 券	5,410,000,000	101.07 5,468,112,900	101.50 5,491,366,400	0.1 2028/3/20	1.09
3	4 2 0 回 利付国庫債券 ( 2 年 ) 日本	国債証 券	4,900,000,000	100.38 4,919,106,000	100.34 4,916,660,000	0.1 2023/1/1	0.97
4	3 4 5 回 利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 日本	国債証 券	4,790,000,000	101.04 4,840,265,400	101.24 4,849,683,400	0.1 2026/12/20	0.96
5	3 2 9 回 利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 日本	国債証 券	4,750,000,000	102.02 4,845,982,800	101.74 4,832,887,500	0.8 2023/6/20	0.96
6	3 4 0 回 利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 日本	国債証 券	4,710,000,000	102.28 4,817,604,200	102.24 4,815,739,500	0.4 2025/9/20	0.95
7	3 3 4 回 利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 日本	国債証 券	4,640,000,000	102.32 4,747,984,600	102.14 4,739,342,400	0.6 2024/6/20	0.94

8	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,630,000,000	102.08 4,726,675,000	101.94 4,719,822,000	0.6 2024/3/20	0.93
9	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,530,000,000	102.01 4,621,158,000	101.98 4,620,056,400	0.4 2025/3/20	0.92
10	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,530,000,000	101.07 4,578,638,100	101.48 4,597,044,000	0.1 2027/12/20	0.91
11	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.99 4,544,722,000	101.13 4,550,850,000	0.1 2026/6/20	0.90
12	330回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,460,000,000	102.23 4,559,598,700	101.97 4,548,263,400	0.8 2023/9/20	0.90
13	147回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,524,288,000	100.62 4,528,260,000	0.005 2026/3/20	0.90
14	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,420,000,000	101.91 4,504,548,900	101.91 4,504,775,600	0.3 2025/12/20	0.89
15	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,410,000,000	102.17 4,505,799,400	102.12 4,503,800,700	0.4 2025/6/20	0.89
16	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,390,000,000	101.10 4,438,713,200	101.42 4,452,425,800	0.1 2027/9/20	0.88
17	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,390,000,000	100.99 4,433,772,700	101.18 4,442,153,200	0.1 2026/9/20	0.88
18	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,340,000,000	101.02 4,384,319,000	101.58 4,408,702,200	0.1 2028/9/20	0.87
19	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,350,000,000	100.96 4,391,930,000	100.99 4,393,369,500	0.1 2025/9/20	0.87
20	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,330,000,000	101.08 4,376,889,400	101.36 4,389,017,900	0.1 2027/6/20	0.87
21	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,300,000,000	102.14 4,392,326,000	102.01 4,386,602,000	0.5 2024/9/20	0.87
22	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,310,000,000	101.01 4,353,921,500	101.60 4,379,003,100	0.1 2028/12/20	0.87
23	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,300,000,000	101.11 4,347,858,200	101.56 4,367,123,000	0.1 2028/6/20	0.87
24	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,290,000,000	101.08 4,336,693,000	101.30 4,345,941,600	0.1 2027/3/20	0.86



25	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,280,000,000	100.99 4,322,377,000	101.07 4,325,838,800	0.1 2026/3/20	0.86
26	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,180,000,000	101.93 4,260,720,400	101.74 4,252,941,000	0.6 2023/12/20	0.84
27	142回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,130,000,000	100.83 4,164,664,900	100.83 4,164,402,900	0.1 2024/12/20	0.82
28	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,100,000,000	100.90 4,136,977,000	100.95 4,139,196,000	0.1 2025/6/20	0.82
29	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,950,000,000	100.49 3,969,651,000	100.96 3,988,038,500	0.1 2031/3/20	0.79
30	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,940,000,000	100.41 3,956,444,500	101.19 3,986,886,000	0.1 2030/9/20	0.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	85.41
地方債証券	5.37
特殊債券	5.15
社債券	3.80
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

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,478,100	8,442.46 12,478,807,343	9,805.00 14,492,770,500	- -	3.71
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	913,800	11,772.06 10,757,316,407	11,375.00 10,394,475,000	- -	2.66
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	143,200	55,531.38 7,952,094,533	60,740.00 8,697,968,000	- -	2.23
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,135,900	9,201.51 10,452,005,351	6,837.00 7,766,148,300	- -	1.99
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,842,600	559.31 5,505,138,493	578.50 5,693,944,100	- -	1.46

6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	998,600	5,127.41 5,120,234,254	5,629.00 5,621,119,400	- -	1.44
7	任天堂 日本	株式 その他製品	83,600	63,545.89 5,312,436,409	56,400.00 4,715,040,000	- -	1.21
8	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,674,500	2,822.45 4,726,202,543	2,802.50 4,692,786,250	- -	1.20
9	信越化学工業 日本	株式 化学	264,200	18,318.38 4,839,717,623	17,750.00 4,689,550,000	- -	1.20
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,213,600	3,731.65 4,528,740,580	3,682.00 4,468,475,200	- -	1.14
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	701,000	5,288.26 3,707,076,355	6,258.00 4,386,858,000	- -	1.12
12	HOYA 日本	株式 精密機器	284,600	13,532.36 3,851,311,208	15,405.00 4,384,263,000	- -	1.12
13	日本電産 日本	株式 電気機器	351,300	13,662.03 4,799,472,658	12,240.00 4,299,912,000	- -	1.10
14	ダイキン工業 日本	株式 機械	185,700	22,598.76 4,196,589,827	22,665.00 4,208,890,500	- -	1.08
15	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,148,600	3,183.61 3,656,697,244	3,493.00 4,012,059,800	- -	1.03
16	村田製作所 日本	株式 電気機器	428,900	9,145.87 3,922,667,120	9,040.00 3,877,256,000	- -	0.99
17	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	85,500	43,426.62 3,712,976,533	44,920.00 3,840,660,000	- -	0.98
18	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,148,100	3,419.67 3,926,127,985	3,332.00 3,825,469,200	- -	0.98
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	995,900	3,740.11 3,724,779,995	3,695.00 3,679,850,500	- -	0.94
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,005,200	3,208.18 3,224,866,941	3,232.00 3,248,806,400	- -	0.83
21	ファナック 日本	株式 電気機器	128,100	27,575.10 3,532,370,313	24,380.00 3,123,078,000	- -	0.80
22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,955,100	1,573.18 3,075,725,570	1,565.50 3,060,709,050	- -	0.78
23	三井物産 日本	株式 卸売業	1,145,800	2,185.54 2,504,198,962	2,499.50 2,863,927,100	- -	0.73
24	SMC 日本	株式 機械	42,600	64,802.39 2,760,582,100	64,800.00 2,760,480,000	- -	0.71
25	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	562,000	4,506.93 2,532,896,180	4,868.00 2,735,816,000	- -	0.70
26	三菱商事 日本	株式 卸売業	874,500	2,931.50 2,563,599,669	3,062.00 2,677,719,000	- -	0.69

27	第一三共 日本	株式 医薬品	1,146,000	3,016.25 3,456,630,998	2,159.50 2,474,787,000	- -	0.63
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	473,700	5,450.56 2,581,933,659	5,210.00 2,467,977,000	- -	0.63
29	富士通 日本	株式 電気機器	131,400	16,984.08 2,231,708,357	18,565.00 2,439,441,000	- -	0.62
30	デンソー 日本	株式 輸送用機器	321,200	7,005.93 2,250,304,787	7,482.00 2,403,218,400	- -	0.61

(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

2021年7月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.23
合計	97.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2021年7月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.97
情報・通信業		8.26
輸送用機器		7.87
化学		6.93
サービス業		5.51
機械		5.36
医薬品		4.92
銀行業		4.79
卸売業		4.74
小売業		4.45
食料品		3.28
陸運業		3.19
精密機器		2.72
建設業		2.29
その他製品		2.25
不動産業		1.93
保険業		1.85
電気・ガス業		1.17
その他金融業		1.09
鉄鋼		0.79
ガラス・土石製品		0.75
証券、商品先物取引業		0.73
非鉄金属		0.71
ゴム製品		0.70
金属製品		0.61
繊維製品		0.49
空運業		0.44
石油・石炭製品		0.41
海運業		0.35
パルプ・紙		0.24

鉱業	0.18
倉庫・運輸関連業	0.18
水産・農林業	0.09
合計	97.23

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	974,461,000	95.55 931,153,458	96.78 943,133,598	0.875 2030/11/15	0.65
2	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	675,553,300	113.96 769,916,910	114.55 773,851,580	3.125 2028/11/15	0.53
3	US T N/B 0.125 09/30/22 アメリカ	国債証 券	769,714,700	99.97 769,530,738	100.03 770,015,365	0.125 2022/9/30	0.53
4	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	751,101,400	95.88 720,178,863	98.78 741,976,688	1.125 2031/2/15	0.51
5	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証 券	721,539,100	103.34 745,665,563	102.51 739,662,126	2 2022/11/30	0.51
6	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	679,932,900	93.92 638,658,844	94.86 645,006,657	0.625 2030/8/15	0.44
7	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	604,384,800	107.02 646,833,385	105.76 639,207,747	2.75 2023/11/15	0.44
8	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証 券	615,333,800	102.61 631,414,201	101.95 627,376,072	1.625 2022/11/15	0.43
9	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証 券	604,384,800	103.73 626,954,794	102.80 621,359,508	2.125 2022/12/31	0.43
10	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	582,486,800	107.55 626,491,853	106.30 619,233,520	2.75 2024/2/15	0.42
11	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証 券	567,158,200	106.80 605,751,539	105.70 599,526,093	2 2025/8/15	0.41
12	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証 券	574,822,500	102.64 590,001,406	101.93 585,937,227	1.75 2022/9/30	0.40
13	US T N/B 0.125 11/30/22 アメリカ	国債証 券	584,676,600	100.02 584,836,467	100.01 584,767,955	0.125 2022/11/30	0.40
14	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証 券	545,260,200	103.17 562,597,767	102.40 558,380,523	1.75 2023/1/31	0.38
15	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	513,508,100	108.07 554,989,284	106.96 549,273,132	2.25 2025/11/15	0.38
16	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証 券	547,450,000	100.10 548,045,893	100.15 548,305,390	0.375 2024/4/15	0.38
17	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証 券	522,267,300	105.67 551,889,647	104.71 546,870,982	2 2024/5/31	0.37
18	US T N/B 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証 券	547,450,000	99.90 546,908,024	99.76 546,145,525	0.25 2024/5/15	0.37
19	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証 券	547,450,000	99.57 545,131,067	99.65 545,546,751	0.125 2024/1/15	0.37
20	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	485,040,700	113.13 548,740,181	112.39 545,178,164	2.875 2028/5/15	0.37

21	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	513,508,100	107.10 549,975,195	105.97 544,178,171	2.25 2024/11/15	0.37
22	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	571,537,800	92.50 528,727,166	95.16 543,920,916	0.625 2030/5/15	0.37
23	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	300,554,100	179.14 538,413,606	178.88 537,632,376	4.5 2041/4/25	0.37
24	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	478,471,300	112.14 536,598,082	111.40 533,046,932	2.75 2028/2/15	0.36
25	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証券	526,646,900	99.75 525,335,549	99.88 526,029,732	0.25 2024/3/15	0.36
26	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	426,760,800	120.87 515,845,425	120.74 515,284,646	2.75 2027/10/25	0.35
27	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	450,003,900	111.60 502,211,379	111.14 500,172,299	2.625 2029/2/15	0.34
28	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証券	474,091,700	105.81 501,648,280	104.71 496,425,861	2.5 2023/8/15	0.34
29	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	470,807,000	106.45 501,188,175	105.35 496,020,917	2 2025/2/15	0.34
30	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	448,909,000	104.27 468,088,260	110.39 495,553,450	2.375 2051/5/15	0.34

（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

2021年7月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.85
合計	98.85

（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

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,597,566	14,699.55 23,483,515,481	15,946.12 25,474,984,895	- -	4.32
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	681,800	26,906.30 18,344,719,065	31,368.88 21,387,305,793	- -	3.63
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	40,745	358,324.73 14,599,941,441	394,155.24 16,059,855,286	- -	2.72

4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	229,029	30,313.96 6,942,777,987	39,232.45 8,985,370,348	- -	1.52
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	28,694	232,248.53 6,664,139,563	297,325.56 8,531,459,891	- -	1.45
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	27,998	233,621.57 6,540,936,993	298,996.38 8,371,300,840	- -	1.42
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	73,128	86,232.28 6,305,994,863	74,163.05 5,423,395,630	- -	0.92
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	235,800	16,521.54 3,895,781,323	21,527.92 5,076,284,432	- -	0.86
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	290,618	15,765.04 4,581,605,734	16,751.96 4,868,424,017	- -	0.83
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	250,084	18,200.45 4,551,642,003	18,851.98 4,714,580,617	- -	0.80
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	161,378	23,273.39 3,755,813,234	27,144.76 4,380,567,208	- -	0.74
12	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	90,263	36,931.81 3,333,576,790	45,118.63 4,072,543,730	- -	0.69
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	130,659	27,102.85 3,541,231,686	30,630.92 4,002,205,689	- -	0.68
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	274,327	12,303.58 3,375,206,233	13,740.64 3,769,429,920	- -	0.64
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	102,578	30,828.80 3,162,357,163	35,850.31 3,677,453,170	- -	0.62

16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	84,411	37,840.82 3,194,181,639	42,570.80 3,593,444,381	- -	0.61
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	234,237	14,064.67 3,294,466,123	15,271.66 3,577,189,041	- -	0.61
18	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	173,115	20,491.33 3,547,357,701	19,527.54 3,380,510,346	- -	0.57
19	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	39,970	64,770.03 2,588,858,218	83,621.69 3,342,359,229	- -	0.57
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	106,102	32,070.47 3,402,741,390	31,004.28 3,289,616,466	- -	0.56
21	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	740,316	3,772.58 2,792,901,566	4,235.07 3,135,292,451	- -	0.53
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	45,638	54,604.95 2,492,061,022	68,069.93 3,106,575,602	- -	0.53
23	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	67,324	37,920.04 2,552,929,063	42,007.45 2,828,110,237	- -	0.48
24	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	435,455	5,884.20 2,562,307,521	6,362.46 2,770,566,717	- -	0.47
25	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	404,291	5,700.70 2,304,744,902	6,452.24 2,608,584,866	- -	0.44
26	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	530,884	3,849.44 2,043,610,639	4,685.07 2,487,232,471	- -	0.42
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	389,600	5,597.30 2,180,710,439	6,246.40 2,433,599,193	- -	0.41
28	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	90,909	25,968.44 2,360,765,729	26,719.93 2,429,082,989	- -	0.41
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	401,554	5,249.86 2,108,102,462	6,029.61 2,421,215,740	- -	0.41
30	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	392,604	5,970.95 2,344,222,028	6,129.25 2,406,368,145	- -	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

2021年7月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.48
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.07
合計	97.72

(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

2021年7月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.56
銀行		5.76
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.88
情報技術サービス		4.60
コンピュータ・周辺機器		4.59
医薬品		4.59
半導体・半導体製造装置		4.51
インターネット販売・通信販売		3.26
資本市場		3.21
ヘルスケア機器・用品		3.02
石油・ガス・消耗燃料		2.89
保険		2.88
化学		2.08
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.92
ホテル・レストラン・レジャー		1.81
バイオテクノロジー		1.76
電力		1.70
機械		1.70
専門小売り		1.67
自動車		1.62
飲料		1.59
金属・鉱業		1.59
繊維・アパレル・贅沢品		1.58
食品		1.54
航空宇宙・防衛		1.45
娯楽		1.40
各種電気通信サービス		1.35
食品・生活必需品小売り		1.33
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.15
コングロマリット		1.13
メディア		1.08
家庭用品		1.06
陸運・鉄道		1.00
各種金融サービス		0.91
電気設備		0.88
専門サービス		0.81
総合公益事業		0.78
通信機器		0.67
航空貨物・物流サービス		0.67
タバコ		0.65
パーソナル用品		0.63
建設関連製品		0.63
電子装置・機器・部品		0.56
複合小売り		0.53
消費者金融		0.49
商業サービス・用品		0.43



不動産管理・開発	0.42
家庭用耐久財	0.37
商社・流通業	0.32
無線通信サービス	0.28
容器・包装	0.28
自動車部品	0.27
建設資材	0.25
建設・土木	0.21
ヘルスケア・テクノロジー	0.16
エネルギー設備・サービス	0.14
ガス	0.14
運送インフラ	0.13
紙製品・林産品	0.11
水道	0.11
販売	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
海運業	0.08
レジャー用品	0.07
旅客航空輸送業	0.05
合計	95.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,956,230,000	124.09 3,668,667,962	127.36 3,765,202,339	5.25 2047/6/23	2.43
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	2,408,780,000	117.98 2,841,974,119	120.85 2,911,010,630	5.1 2035/3/28	1.88
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	2,299,290,000	109.28 2,512,669,586	104.17 2,395,262,364	5 2045/6/15	1.55
4	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	2,014,616,000	112.65 2,269,595,217	114.03 2,297,468,086	4.75 2026/5/27	1.48
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,751,840,000	126.79 2,221,302,462	130.29 2,282,638,760	5.625 2042/4/4	1.48
6	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,631,401,000	123.09 2,008,216,966	126.03 2,056,111,779	6.05 2040/1/11	1.33
7	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,751,840,000	112.64 1,973,391,920	113.81 1,993,795,381	4.5 2029/4/22	1.29
8	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,795,636,000	109.14 1,959,828,955	108.73 1,952,529,695	4.875 2023/9/16	1.26

9	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,412,421,000	135.40 1,912,559,276	135.97 1,920,610,075	6.7 2036/1/26	1.24
10	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	1,259,135,000	149.53 1,882,842,420	152.42 1,919,290,540	7.75 2038/1/17	1.24
11	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,686,146,000	111.49 1,879,969,577	113.67 1,916,810,772	4.375 2029/3/21	1.24
12	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,686,146,000	110.87 1,869,597,370	112.16 1,891,282,522	4.25 2027/6/23	1.22
13	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,861,330,000	100.82 1,876,704,585	100.72 1,874,843,255	2.783 2031/1/23	1.21
14	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,313,880,000	135.66 1,782,430,958	137.21 1,802,787,886	5.625 2050/11/18	1.17
15	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,576,656,000	114.38 1,803,450,629	113.17 1,784,388,311	6 2024/1/26	1.15
16	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,751,840,000	99.30 1,739,730,406	100.84 1,766,608,011	3.875 2030/6/12	1.14
17	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,554,758,000	111.97 1,740,907,204	113.40 1,763,095,572	5.875 2025/9/16	1.14
18	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 メキシコ	国債証券	1,532,860,000	113.19 1,735,112,117	114.83 1,760,321,095	4.75 2032/4/27	1.14
19	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,620,452,000	107.56 1,743,055,836	108.60 1,759,851,383	4.625 2028/1/13	1.14
20	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,729,942,000	98.71 1,707,671,186	99.92 1,728,609,944	5 2045/1/27	1.12
21	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	985,410,000	162.88 1,605,085,735	168.49 1,660,405,010	7.625 2041/3/29	1.07
22	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,357,676,000	117.75 1,598,758,527	121.72 1,652,644,687	5.55 2045/1/21	1.07
23	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,464,976,200	113.62 1,664,630,185	112.53 1,648,681,285	5.375 2024/3/25	1.07
24	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,532,860,000	104.92 1,608,415,326	106.01 1,624,992,550	4.85 2029/9/30	1.05
25	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,423,370,000	113.18 1,611,084,035	112.09 1,595,579,266	5.75 2023/11/22	1.03
26	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	1,423,370,000	115.58 1,645,175,936	111.19 1,582,758,972	5.625 2044/2/26	1.02
27	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,291,982,000	115.80 1,496,214,025	119.85 1,548,505,026	5.75 2110/10/12	1.00
28	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	1,094,900,000	139.72 1,529,808,513	141.28 1,546,956,826	6.375 2034/10/23	1.00
29	INDONESIA 6.75 01/15/44 インドネシア	国債証券	1,040,155,000	145.21 1,510,488,399	148.58 1,545,557,836	6.75 2044/1/15	1.00

30	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,357,676,000	112.08 1,521,798,663	113.76 1,544,553,313	4.15 2027/3/28	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

2021年7月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.32
合計	98.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,441,083	2,371.34 3,417,298,077	2,286.52 3,295,073,747	- -	5.48
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	887,568	3,187.61 2,829,222,796	2,779.95 2,467,400,874	- -	4.11
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	337,000	8,843.66 2,980,314,393	6,932.28 2,336,178,360	- -	3.89
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	279,951	7,951.64 2,226,071,808	7,560.29 2,116,513,545	- -	3.52
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	212,000	4,050.05 858,612,427	3,218.15 682,249,072	- -	1.14
6	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	230,721	2,333.21 538,322,611	2,490.12 574,525,054	- -	0.96

7	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	25,534	25,922.31 661,900,268	21,475.07 548,344,445	- -	0.91
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	166,403	2,869.63 477,516,174	3,038.80 505,667,100	- -	0.84
9	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	199,050	2,006.57 399,409,549	2,393.16 476,358,498	- -	0.79
10	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,603,530	91.36 511,961,712	76.22 427,139,720	- -	0.71
11	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	50,835	8,339.48 423,937,669	7,875.61 400,356,924	- -	0.67
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	100,287	3,797.49 380,839,000	3,573.90 358,416,110	- -	0.60
13	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	76,062	3,951.06 300,525,695	4,666.46 354,940,569	- -	0.59
14	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	32,124	12,871.07 413,470,444	10,909.79 350,466,415	- -	0.58
15	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC ケイマン諸島	株式 ライフサ イエンス・ツ ール/サー ビス	199,000	1,517.89 302,061,089	1,755.61 349,367,186	- -	0.58
16	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	363,500	1,246.42 453,075,235	951.77 345,971,848	- -	0.58
17	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	47,221	7,159.77 338,091,765	6,947.81 328,083,008	- -	0.55
18	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	88,507	3,743.23 331,302,247	3,659.22 323,867,115	- -	0.54

19	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	729,225	475.50 346,749,320	435.34 317,462,269	- -	0.53
20	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周 辺機 器	845,400	372.26 314,714,675	364.93 308,512,667	- -	0.51
21	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	299,985	865.11 259,520,297	1,017.49 305,234,737	- -	0.51
22	NAVER CORP 韓国	株式 インタ ラク ティブ ・メ ディア およ びサ ービ ス	7,239	36,811.51 266,478,580	42,060.14 304,473,425	- -	0.51
23	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消 耗燃 料	351,271	693.20 243,502,527	857.74 301,300,824	- -	0.50
24	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	160,668	1,696.09 272,508,148	1,818.08 292,107,510	- -	0.49
25	BAIDU INC -SPON ADR 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	15,867	22,901.45 363,377,342	18,291.39 290,229,634	- -	0.48
26	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	23,636	11,848.52 280,051,691	11,047.54 261,119,679	- -	0.43
27	PINDUODUO INC ADR ケイマン諸島	株式 インタ ーネ ット 販 売・通 信 販 売	25,812	14,517.12 374,716,029	10,084.02 260,288,956	- -	0.43
28	KAKAO CORP 韓国	株式 インタ ラク ティブ ・メ ディア およ びサ ービ ス	18,304	11,363.92 208,005,227	14,211.44 260,126,380	- -	0.43
29	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技 術サ ービ ス	53,622	4,709.03 252,507,913	4,729.78 253,620,477	- -	0.42

30	LUKOIL SPON ADR	株式 石油・ガス・消耗 燃料	25,186	8,769.35 220,865,034	9,591.32 241,567,086	- -	0.40
----	-----------------	----------------------	--------	-------------------------	-------------------------	--------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	85.83
投資信託受益証券	0.66
投資証券	0.08
合計	86.56

(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

2021年7月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	10.91
半導体・半導体製造装置		8.04
インターネット販売・通信販売		7.73
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.80
コンピュータ・周辺機器		5.24
石油・ガス・消耗燃料		4.36
金属・鉱業		4.24
自動車		2.80
化学		2.52
電子装置・機器・部品		2.50
保険		2.24
情報技術サービス		1.93
食品		1.54
不動産管理・開発		1.50
無線通信サービス		1.32
医薬品		1.23
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.08
繊維・アパレル・贅沢品		1.07
食品・生活必需品小売り		1.01
娯楽		1.00
各種電気通信サービス		0.97
飲料		0.96
資本市場		0.91
バイオテクノロジー		0.86
コングロマリット		0.79
建設資材		0.77
ホテル・レストラン・レジャー		0.65
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.62
各種金融サービス		0.61
電力		0.60
貯蓄・抵当・不動産金融		0.60
パーソナル用品		0.55

専門小売り	0.55
電気設備	0.53
海運業	0.51
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.50
ガス	0.50
運送インフラ	0.49
自動車部品	0.49
消費者金融	0.45
機械	0.45
建設・土木	0.43
家庭用耐久財	0.39
複合小売り	0.35
ソフトウェア	0.35
家庭用品	0.34
ヘルスケア機器・用品	0.30
タバコ	0.26
陸運・鉄道	0.25
航空貨物・物流サービス	0.23
商業サービス・用品	0.23
通信機器	0.19
紙製品・林産品	0.17
メディア	0.12
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
旅客航空輸送業	0.10
航空宇宙・防衛	0.10
各種消費者サービス	0.10
水道	0.09
商社・流通業	0.08
レジャー用品	0.06
容器・包装	0.06
エネルギー設備・サービス	0.05
専門サービス	0.03
建設関連製品	0.02
総合公益事業	0.02
販売	0.00
合計	85.83

(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。

#### D I A Mマネーマザーファンド

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	413回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	210,000,000	100.19 210,417,900	100.19 210,401,100	0.1 2022/6/1	20.15
2	407回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	200,000,000	100.12 200,254,000	100.07 200,148,000	0.1 2021/12/1	19.17

3	27回 政保地方公共団体 金融機構債券 日本	特殊債 券	154,000,000	100.35 154,552,860	100.03 154,058,520	1 2021/8/13	14.75
4	147回政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債 券	100,000,000	100.57 100,572,000	100.25 100,253,000	1 2021/10/29	9.60

(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

2021年7月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	39.32
特殊債券	24.36
合計	63.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

D I A Mマネーマザーファンド

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



2021年7月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0309月	買建	574	11,128,323,620	10,934,700,000	2.80

(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場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Sep21	買建	422	9,984,327,406	10,192,312,420	1.73
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep21	買建	398	2,104,855,826	2,129,607,952	0.36
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep21	買建	57	607,290,505	610,165,449	0.10
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep21	買建	23	486,322,646	490,493,289	0.08
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Sep21	買建	20	292,397,846	296,392,330	0.05

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

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

2021年7月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Sep21	買建	1,146	8,401,219,707	8,094,427,085	13.47

(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場で評価しています。

D I A Mマネーマザーファンド

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

直近日(2021年7月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2013年1月11日)	54	54	1.0953	1.0953
第2特定期間末 (2013年7月11日)	57	57	1.1501	1.1501
第4計算期間末 (2014年1月14日)	836	836	1.1801	1.1801
第5計算期間末 (2014年7月11日)	4,833	4,833	1.1888	1.1888
第6計算期間末 (2015年1月13日)	7,664	7,664	1.2660	1.2660
第7計算期間末 (2015年7月13日)	16,373	16,373	1.2816	1.2816
第8計算期間末 (2016年1月12日)	29,373	29,373	1.2200	1.2200
第9計算期間末 (2016年7月11日)	30,524	30,524	1.1796	1.1796
第10計算期間末 (2017年1月11日)	33,083	33,083	1.2331	1.2331
第11計算期間末 (2017年7月11日)	32,461	32,461	1.2524	1.2524
第12計算期間末 (2018年1月11日)	28,678	28,678	1.2864	1.2864
第13計算期間末 (2018年7月11日)	27,026	27,026	1.2537	1.2537
第14計算期間末 (2019年1月11日)	24,449	24,449	1.2062	1.2062
第15計算期間末 (2019年7月11日)	22,938	22,938	1.2287	1.2287
第16計算期間末 (2020年1月14日)	20,607	20,607	1.2590	1.2590
第17計算期間末 (2020年7月13日)	18,748	18,748	1.2562	1.2562
第18計算期間末 (2021年1月12日)	16,160	16,160	1.2941	1.2941
第19計算期間末 (2021年7月12日)	13,725	13,725	1.3111	1.3111
2020年7月末日	18,394	-	1.2512	-
8月末日	18,144	-	1.2671	-
9月末日	17,566	-	1.2569	-
10月末日	17,102	-	1.2502	-
11月末日	16,872	-	1.2702	-
12月末日	16,115	-	1.2818	-
2021年1月末日	15,659	-	1.2896	-
2月末日	15,062	-	1.2906	-
3月末日	14,906	-	1.3087	-
4月末日	14,517	-	1.3083	-

5月末日	14,307	-	1.3115	-
6月末日	13,874	-	1.3134	-
7月末日	13,507	-	1.3046	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

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

（注1）収益率は期間騰落率です。

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

## （４）【設定及び解約の実績】

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

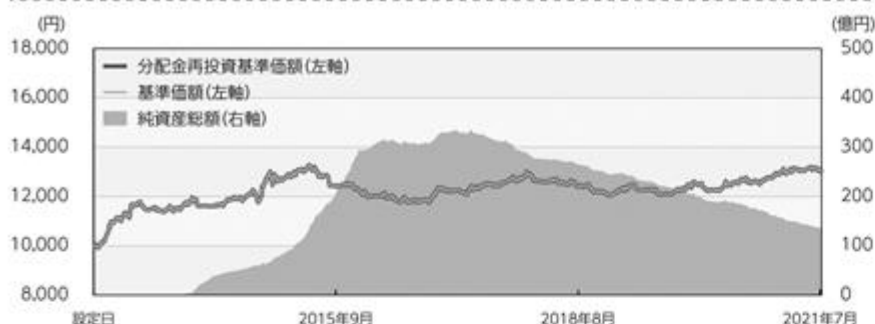
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2021年7月30日

## 基準価額・純資産の推移 (2012年10月26日~2021年7月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2012年10月26日)

## 分配の推移(税引前)

2019年 7月	0円
2020年 1月	0円
2020年 7月	0円
2021年 1月	0円
2021年 7月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.49
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.65
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	9.35
4	DIAMマネーマザーファンド	7.39
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.82
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4.78
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.68

## ■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	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2022/9/20	1.14
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.09
3	420回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2023/1/1	0.97
4	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	0.96
5	329回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2023/6/20	0.96

## ■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	3.71
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.66
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.23
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.99
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.46

## ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.65
2	US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	0.53
3	US T N/B 0.125 09/30/22	国債証券	アメリカ	0.125	2022/9/30	0.53
4	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.51
5	US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	アメリカ	2	2022/11/30	0.51

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年7月30日

### ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.32
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.63
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.72
4	FACEBOOK INC	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	1.52
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	1.45

### ■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	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.43
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.88
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.55
4	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	ロシア	4.75	2026/5/27	1.48
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.48

### ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	5.48
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	4.11
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	3.89
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.52
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.14

### ■DIAMマネーマザーファンド

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

#### 組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	413回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2022/6/1	20.15
2	407回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2021/12/1	19.17
3	27回 政保地方公共団体金融機構債券	特殊債券	日本	1	2021/8/13	14.75
4	147回政保日本高速道路保有・債務返済機構	特殊債券	日本	1	2021/10/29	9.60

## 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。

※2012年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

「基準価額」とは、純資産総額(ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額)を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。(ただし、便宜上1万口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、3.3%(税抜3.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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



## 2【換金（解約）手続等】

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

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

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

### ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

### ・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

### ・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

#### (4)【計算期間】

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

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

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

## (5) 【その他】

### イ.償還規定

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

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

#### ロ. 信託約款の変更等

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

#### ハ. 関係法人との契約の更改

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

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

## 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1月11日、7月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

## 4【受益者の権利等】

### 収益分配金請求権

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

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

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

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

### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

#### 一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、解約の請求をすることができます。

#### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間(2021年1月13日から2021年7月12日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【クルーズコントロール】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,759,014,810	3,261,478,940
親投資信託受益証券	12,557,887,965	8,594,590,441
未収入金	-	2,028,000,000
流動資産合計	16,316,902,775	13,884,069,381
資産合計	16,316,902,775	13,884,069,381
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	21,369,219	45,715,762
未払受託者報酬	4,815,246	4,032,988
未払委託者報酬	130,012,917	108,892,015
その他未払費用	344,928	287,060
流動負債合計	156,542,310	158,927,825
負債合計	156,542,310	158,927,825
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	12,487,670,935	10,468,617,077
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,672,689,530	3,256,524,479
（分配準備積立金）	619,209,479	681,694,578
元本等合計	16,160,360,465	13,725,141,556
純資産合計	16,160,360,465	13,725,141,556
負債純資産合計	16,316,902,775	13,884,069,381



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第18期		第19期	
	自	2020年7月14日 2021年1月12日	自	2021年1月13日 2021年7月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		3,185		931
有価証券売買等損益		638,337,187		313,702,476
営業収益合計		638,340,372		313,703,407
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,011,500		353,918
受託者報酬		4,815,246		4,032,988
委託者報酬		130,012,917		108,892,015
その他費用		350,868		287,060
営業費用合計		136,190,531		113,565,981
営業利益又は営業損失( )		502,149,841		200,137,426
経常利益又は経常損失( )		502,149,841		200,137,426
当期純利益又は当期純損失( )		502,149,841		200,137,426
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( )		30,770,242		25,346,825
期首剰余金又は期首欠損金( )		3,823,159,809		3,672,689,530
剰余金増加額又は欠損金減少額		81,333,302		82,282,555
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		81,333,302		82,282,555
剰余金減少額又は欠損金増加額		703,183,180		673,238,207
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		703,183,180		673,238,207
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( )		3,672,689,530		3,256,524,479

## (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19期	
	自 2021年1月13日	至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日及び7月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2021年1月12日、当計算期間末日を2021年7月12日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第18期	第19期
	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 期首元本額	14,925,337,293円	12,487,670,935円
期中追加設定元本額	306,787,422円	269,416,421円
期中一部解約元本額	2,744,453,780円	2,288,470,279円
2. 受益権の総数	12,487,670,935口	10,468,617,077口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期	第19期
	自 2020年7月14日 至 2021年1月12日	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(67,563,198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(24,586,012円)、信託約款に規定される収益調整金(3,095,923,305円)及び分配準備積立金(527,060,269円)より分配対象収益は3,715,132,784円(1万口当たり2,975.04円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(53,934,023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(120,856,578円)、信託約款に規定される収益調整金(2,607,761,411円)及び分配準備積立金(506,903,977円)より分配対象収益は3,289,455,989円(1万口当たり3,142.20円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第18期	第19期
	自 2020年7月14日 至 2021年1月12日	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	591,611,739	85,757,427
合計	591,611,739	85,757,427

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2941円 (12,941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

2021年7月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	466,515,120	1,493,921,368	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,148,879,451	1,504,687,416	
	D I A Mマネーマザーファンド	990,000,991	997,821,998	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	146,215,612	796,568,032	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,109,737,016	2,276,958,409	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	505,768,379	748,840,661	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	355,525,667	775,792,557	
親投資信託受益証券 合計		4,722,642,236	8,594,590,441	
合計			8,594,590,441	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「D I A Mマネーマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2021年7月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,946,089,561
国債証券	426,492,683,100
地方債証券	26,894,257,824
特殊債券	25,966,555,375
社債券	19,066,493,310
未収利息	487,539,989
前払費用	260,607,560
流動資産合計	501,114,226,719
資産合計	
501,114,226,719	
負債の部	
流動負債	
未払金	1,779,490,000
未払解約金	1,119,630,000
流動負債合計	2,899,120,000
負債合計	
2,899,120,000	
純資産の部	
元本等	
元本	380,394,285,340
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	117,820,821,379
元本等合計	498,215,106,719
純資産合計	498,215,106,719
負債純資産合計	501,114,226,719

## 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1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年7月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	197,306,195,501円
同期中追加設定元本額	276,468,106,848円
同期中一部解約元本額	93,380,017,009円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,042,911,051円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	58,205,108円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	85,026,637円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,528,789円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	762,444,247円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	149,488,676円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	24,482,688円
たわらノーロード 国内債券	14,138,281,498円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,870,432,413円
たわらノーロード バランス(堅実型)	659,009,703円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,077,867,513円
たわらノーロード バランス(積極型)	133,979,181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)	50,322,288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)	1,032,135,636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)	1,094,659,034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)	350,082,359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)	128,135,170円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	15,940,274円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,991,762円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	38,385,735円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,389,438円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	526,112円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,300,394,933円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,446,193,209円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	11,541,004,280円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,700,092,508円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,096,709,968円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,236,320,578円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	360,423,278円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	91,048,387円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,946,750,943円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	11,576,024円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,064,417,972円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,438,859,401円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	307,531,452円
投資のソムリエ	32,541,418,322円
クルーズコントロール	1,148,879,451円
投資のソムリエ<DC年金>	1,702,737,896円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,025,527,772円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	573,924,594円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	4,279,923円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	11,122,583円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	4,535,158,253円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	45,906,962,887円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	20,472,952円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,830,866円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	42,959,192円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	65,602,701円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	852,419,295円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	26,167,512,808円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,822,902,454円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	17,160,892円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	7,507,845円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,449,612円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	99,528,079円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	68,818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)	598,662,625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)	726,846,339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)	1,290,319,095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)	369,786,728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)	584,250,960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)	18,572,458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)	1,032,271,266円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,747,700,563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)	812,343,091円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	856,370,636円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	291,849,892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)	5,162,992,260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)	5,175,030,109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)	5,126,419,429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)	5,167,905,553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)	976,865,132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)	181,734,833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)	104,852,782円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	33,643,737円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	106,538,607円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	45,970,685円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,457,241円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	51,354,539円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	139,011,046円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,974,703,712円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,464,392,923円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,684,787,849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)	212,578,555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)	207,933,824円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,416,796,840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)	207,888,215円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	11,392,745円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	2,675,704,471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)	56,466,864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)	423,619,050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)	672,898,045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)	1,168,050,833円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	327,450,906円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	106,712,438円
One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)	1,078,716,030円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	382,409,178円
動的パッケージファンド<DC年金>	271,259,362円
コア資産形成ファンド	213,359,316円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	43,690,787,790円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	39,450,858,281円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	14,867,046,295円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	3,364,296,762円
計	380,394,285,340円
2. 受益権の総数	380,394,285,340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1月13日 至 2021年7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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る場合、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	2021年7月12日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,105,826,050
地方債証券	17,433,752
特殊債券	18,820,982
社債券	6,489,210
合計	1,135,591,574

(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(2021年2月16日から2021年7月12日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

2021年7月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3097円 (13,097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

2021年7月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	416回 利付国庫債券(2年)	1,470,000,000	1,473,675,000	
	417回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,008,220,000	
	418回 利付国庫債券(2年)	400,000,000	401,172,000	
	419回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,404,368,000	
	420回 利付国庫債券(2年)	4,900,000,000	4,916,219,000	
	421回 利付国庫債券(2年)	1,040,000,000	1,043,640,000	
	422回 利付国庫債券(2年)	1,600,000,000	1,605,888,000	
	423回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,006,690,000	
	424回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	501,170,000	
	425回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,004,720,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	3,290,000,000	3,298,389,500	
	134回 利付国庫債券(5年)	2,630,000,000	2,638,310,800	
	135回 利付国庫債券(5年)	3,040,000,000	3,051,278,400	
	136回 利付国庫債券(5年)	3,250,000,000	3,263,877,500	
	137回 利付国庫債券(5年)	3,110,000,000	3,125,332,300	
	138回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,520,090,000	
	139回 利付国庫債券(5年)	3,750,000,000	3,773,737,500	
	140回 利付国庫債券(5年)	3,190,000,000	3,212,074,800	
141回 利付国庫債券(5年)	3,210,000,000	3,234,139,200		

142回 利付国庫債券(5年)	3,730,000,000	3,760,921,700	
143回 利付国庫債券(5年)	3,100,000,000	3,127,528,000	
144回 利付国庫債券(5年)	4,100,000,000	4,138,950,000	
145回 利付国庫債券(5年)	4,350,000,000	4,393,065,000	
146回 利付国庫債券(5年)	3,900,000,000	3,940,014,000	
147回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,326,316,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	159,393,300	
2回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	885,068,100	
3回 利付国庫債券(40年)	440,000,000	619,872,000	
4回 利付国庫債券(40年)	1,020,000,000	1,442,116,800	
5回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	1,284,350,200	
6回 利付国庫債券(40年)	960,000,000	1,292,256,000	
7回 利付国庫債券(40年)	1,010,000,000	1,308,222,700	
8回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	1,464,826,000	
9回 利付国庫債券(40年)	1,730,000,000	1,567,639,500	
10回 利付国庫債券(40年)	1,620,000,000	1,717,410,600	
11回 利付国庫債券(40年)	1,280,000,000	1,315,430,400	
12回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,206,283,000	
13回 利付国庫債券(40年)	1,630,000,000	1,507,798,900	
14回 利付国庫債券(40年)	400,000,000	395,696,000	
325回 利付国庫債券(10年)	5,700,000,000	5,762,073,000	
326回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,031,974,800	
327回 利付国庫債券(10年)	1,970,000,000	1,995,964,600	
328回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,036,210,000	
329回 利付国庫債券(10年)	4,750,000,000	4,834,360,000	
330回 利付国庫債券(10年)	4,460,000,000	4,550,047,400	
331回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,472,910,000	
332回 利付国庫債券(10年)	4,480,000,000	4,559,430,400	
333回 利付国庫債券(10年)	4,030,000,000	4,109,229,800	
334回 利付国庫債券(10年)	4,640,000,000	4,740,548,800	

335回 利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,387,419,000	
336回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,942,009,000	
337回 利付国庫債券(10年)	3,210,000,000	3,258,792,000	
338回 利付国庫債券(10年)	4,530,000,000	4,620,600,000	
339回 利付国庫債券(10年)	4,410,000,000	4,504,241,700	
340回 利付国庫債券(10年)	4,710,000,000	4,816,116,300	
341回 利付国庫債券(10年)	4,420,000,000	4,504,819,800	
342回 利付国庫債券(10年)	4,280,000,000	4,325,368,000	
343回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,549,140,000	
344回 利付国庫債券(10年)	4,390,000,000	4,440,397,200	
345回 利付国庫債券(10年)	4,790,000,000	4,847,671,600	
346回 利付国庫債券(10年)	4,290,000,000	4,344,011,100	
347回 利付国庫債券(10年)	4,330,000,000	4,386,939,500	
348回 利付国庫債券(10年)	4,390,000,000	4,450,186,900	
349回 利付国庫債券(10年)	4,530,000,000	4,593,148,200	
350回 利付国庫債券(10年)	5,410,000,000	5,488,336,800	
351回 利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,060,120,000	
352回 利付国庫債券(10年)	4,340,000,000	4,406,011,400	
353回 利付国庫債券(10年)	4,110,000,000	4,173,129,600	
354回 利付国庫債券(10年)	3,710,000,000	3,765,983,900	
355回 利付国庫債券(10年)	3,810,000,000	3,864,749,700	
356回 利付国庫債券(10年)	3,640,000,000	3,689,431,200	
357回 利付国庫債券(10年)	3,760,000,000	3,809,406,400	
358回 利付国庫債券(10年)	3,650,000,000	3,696,136,000	
359回 利付国庫債券(10年)	3,910,000,000	3,955,512,400	

360回 利付国庫債券(10年)	3,940,000,000	3,981,685,200	
361回 利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	3,835,834,000	
362回 利付国庫債券(10年)	3,550,000,000	3,579,181,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	135,777,400	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	121,128,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	254,384,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	248,678,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,732,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	297,182,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	285,050,500	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	184,560,000	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	436,583,800	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	338,182,000	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	313,346,400	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	350,022,600	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	514,632,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	361,440,800	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	436,227,000	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	402,200,200	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	385,702,900	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	466,753,000	
24回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	361,276,200	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	432,484,800	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	824,296,200	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	838,351,600	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	1,045,814,000	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,158,996,200	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,176,560,000	

31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	953,481,600	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,306,308,700	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,530,094,200	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,604,400,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,760,000,000	2,294,600,000	
36回 利付国庫債券(30年)	1,970,000,000	2,577,075,200	
37回 利付国庫債券(30年)	1,760,000,000	2,273,462,400	
38回 利付国庫債券(30年)	1,280,000,000	1,631,065,600	
39回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	1,582,669,400	
40回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,328,610,400	
41回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	1,359,288,000	
42回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,726,035,600	
43回 利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,349,473,300	
44回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	1,363,467,600	
45回 利付国庫債券(30年)	1,170,000,000	1,425,925,800	
46回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,792,679,700	
47回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,566,343,800	
48回 利付国庫債券(30年)	1,240,000,000	1,487,231,200	
49回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,511,886,600	
50回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,337,175,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,085,761,000	
52回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	1,295,498,300	
53回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,011,150,000	
54回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,216,067,500	
55回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	1,289,222,800	

56回 利付国庫債券(30年)	1,230,000,000	1,297,416,300	
57回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,159,455,000	
58回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,579,905,000	
59回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,151,304,000	
60回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,108,702,300	
61回 利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	1,168,226,400	
62回 利付国庫債券(30年)	1,110,000,000	1,078,520,400	
63回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,133,076,000	
64回 利付国庫債券(30年)	1,280,000,000	1,205,196,800	
65回 利付国庫債券(30年)	1,110,000,000	1,043,388,900	
66回 利付国庫債券(30年)	990,000,000	927,917,100	
67回 利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,234,775,000	
68回 利付国庫債券(30年)	1,280,000,000	1,262,745,600	
69回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,385,207,000	
70回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,353,292,800	
59回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,261,400	
64回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,329,900	
65回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	62,971,200	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,727,500	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,729,500	
71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,747,600	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	492,926,800	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	408,025,000	
74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	43,088,000	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	194,896,800	



76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	75,275,200	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	43,162,400	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	270,135,000	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	54,225,000	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	97,961,400	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	435,884,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	153,148,800	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	76,951,000	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	186,122,800	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	651,708,100	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	133,681,200	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	133,116,000	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	660,741,000	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,149,400	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	526,935,800	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	123,899,600	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,300,963,200	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	414,895,800	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	755,136,900	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	629,585,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	135,928,800	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	755,475,600	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	182,147,200	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	857,752,500	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	959,438,500	

101回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	152,024,600	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	587,930,000	
103回 利付国債(20年)	160,000,000	187,019,200	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	127,036,800	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	742,220,800	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	583,480,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	699,180,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	793,713,900	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	404,054,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	514,764,800	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	543,770,600	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	868,856,200	
113回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,378,540,800	
114回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	969,805,800	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	428,821,200	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	633,742,200	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,270,111,400	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	655,954,500	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	547,070,600	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	767,860,200	
121回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	929,205,900	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	665,195,700	
123回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,258,110,000	
124回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	713,256,000	
125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	726,780,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	607,899,600	

127回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	874,894,600	
128回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,624,614,500	
129回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	893,714,400	
130回 利付国庫債券(20年)	1,410,000,000	1,662,657,900	
131回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	923,541,600	
132回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,324,292,200	
133回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,336,032,900	
134回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,303,896,000	
135回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	634,359,600	
136回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	768,312,600	
137回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	942,040,000	
138回 利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,202,063,200	
139回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	1,073,354,800	
140回 利付国庫債券(20年)	1,990,000,000	2,348,797,000	
141回 利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,833,572,500	
142回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,074,843,000	
143回 利付国庫債券(20年)	1,380,000,000	1,620,009,600	
144回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,057,756,700	
145回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	2,555,769,500	
146回 利付国庫債券(20年)	2,180,000,000	2,596,903,200	
147回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,693,546,400	
148回 利付国庫債券(20年)	2,040,000,000	2,388,758,400	
149回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,580,182,000	
150回 利付国庫債券(20年)	2,310,000,000	2,683,434,600	
151回 利付国庫債券(20年)	2,340,000,000	2,660,135,400	

152回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	2,446,162,500	
153回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	2,559,771,000	
154回 利付国庫債券(20年)	2,090,000,000	2,383,289,700	
155回 利付国庫債券(20年)	2,160,000,000	2,404,166,400	
156回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	2,001,343,500	
157回 利付国庫債券(20年)	2,230,000,000	2,221,927,400	
158回 利付国庫債券(20年)	2,090,000,000	2,172,805,800	
159回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	2,033,428,700	
160回 利付国庫債券(20年)	1,710,000,000	1,826,126,100	
161回 利付国庫債券(20年)	1,790,000,000	1,883,115,800	
162回 利付国庫債券(20年)	1,520,000,000	1,597,793,600	
163回 利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	1,806,481,600	
164回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,354,305,200	
165回 利付国庫債券(20年)	1,810,000,000	1,866,834,000	
166回 利付国庫債券(20年)	1,730,000,000	1,840,097,200	
167回 利付国庫債券(20年)	1,740,000,000	1,790,251,200	
168回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,597,143,000	
169回 利付国庫債券(20年)	1,850,000,000	1,834,386,000	
170回 利付国庫債券(20年)	1,590,000,000	1,573,702,500	
171回 利付国庫債券(20年)	1,640,000,000	1,620,172,400	
172回 利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,466,365,600	
173回 利付国庫債券(20年)	1,920,000,000	1,925,068,800	
174回 利付国庫債券(20年)	1,850,000,000	1,851,646,500	
175回 利付国庫債券(20年)	1,760,000,000	1,791,732,800	
176回 利付国庫債券(20年)	1,880,000,000	1,910,813,200	
国債証券 合計	400,465,000,000	426,492,683,100	

地方債証券	719回 東京都公募公債	200,000,000	202,886,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	305,031,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	407,080,000	
	760回 東京都公募公債	100,000,000	100,129,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	111,369,500	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	402,244,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	247,588,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	131,304,000	
	1回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,977,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,756,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,029,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	224,040,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	335,904,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	116,612,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	117,839,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	100,205,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	404,008,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	100,429,000	
	29回1号 宮城県公募公債 10年	100,000,000	101,544,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	251,267,500	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	303,399,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	304,815,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,949,000	
	251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	202,092,000	
	3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	134,743,000	
	11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	116,080,000	
	16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	357,072,000	
	19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	117,573,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	302,835,000	
	368回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	101,274,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	305,688,000	
	413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,952,000	
	419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,901,000	
	467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	201,240,000	

10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	234,208,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	112,768,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	103,192,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	355,666,500	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	110,494,364	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	202,376,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,300,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,873,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	134,298,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	309,711,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	326,106,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	107,603,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	103,926,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	100,593,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	200,960,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	108,177,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	108,993,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	213,508,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	109,113,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	348,819,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	132,167,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	304,803,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	182,838,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	102,040,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	200,998,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	101,464,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	102,283,000	
25年度8回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,713,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	407,388,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	215,290,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	118,379,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	116,512,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	350,049,000	

15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	112,197,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	203,622,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	101,178,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	202,224,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	100,506,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	108,207,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	114,827,000	
21年度2回 福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,550,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	348,621,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	303,195,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	203,542,000	
25年度6回 千葉県公募公債	100,000,000	101,753,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,423,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	111,037,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	111,808,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	101,588,000	
25年度2回 新潟県公募公債	100,000,000	101,751,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	201,836,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	116,598,000	
115回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,024,000	
118回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,287,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,455,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,045,000	
127回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,544,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,659,000	
132回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,769,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,010,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	406,884,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	612,696,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,055,000	

153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,066,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,429,600	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,642,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,145,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,649,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,239,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,605,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,188,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,257,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	100,999,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	101,767,000	
25年度2回 島根県公募公債	106,000,000	107,675,860	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	101,720,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	101,166,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,358,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	232,026,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	458,518,500	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	116,462,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	112,789,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	112,901,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	238,628,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	234,826,000	
26年度4回 神戸市公募公債	100,000,000	101,813,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	304,383,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	407,084,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	129,981,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	114,975,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	116,517,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	203,084,000	
26年度4回 札幌市公募公債 10年	100,000,000	101,572,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	311,589,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	201,934,000	



	6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	114,593,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	116,465,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	210,406,000	
	2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	97,837,000	
	26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	101,537,000	
	29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	208,426,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	303,765,000	
	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	105,655,000	
	26年度1回 相模原市公募公債	100,000,000	101,672,000	
	26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	101,558,000	
地方債証券 合計		25,545,330,000	26,894,257,824	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	216,546,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	215,538,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	302,577,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,046,000	
	19回 政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,143,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	222,000,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	271,470,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	118,105,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	706,559,000	
	101回 日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,224,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	101,538,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,057,000	
	139回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,514,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,543,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	120,949,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	127,308,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	111,955,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	198,524,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	104,203,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,424,000	
	116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	124,879,000	
	121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	581,030,000	

153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,229,000	
170回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,927,000	
177回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,137,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,182,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	504,985,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,820,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	437,993,700	
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,678,950	
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,724,000	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,889,000	
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,786,000	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	336,657,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,175,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,111,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,776,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	235,758,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,417,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,554,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	805,792,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,466,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,852,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	194,134,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	657,590,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	229,354,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	351,741,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	352,821,000	

13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	119,049,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	323,106,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	234,438,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	116,180,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	233,202,000	
40回 地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,989,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,888,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	405,180,000	
44回 地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,207,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,085,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	552,146,240	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	116,391,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,079,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,442,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	226,918,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	351,303,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,340,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,379,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	104,540,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,870,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,899,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,406,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	233,154,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,047,380	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	109,130,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	107,977,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	214,494,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	198,522,000	

1 1 回 独立行政法人福祉医療 機構	100,000,000	111,890,000	
2 1 回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,618,000	
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	233,598,000	
7 5 回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	416,160,500	
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,638,000	
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	320,487,500	
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,124,000	
1 7 2 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,050,000	
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,559,000	
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,546,000	
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,877,000	
6 回貸付債権担保S種住宅金融 公庫債券	31,911,000	32,316,588	
8 回貸付債権担保S種住宅金融 公庫債券	22,502,000	22,942,814	
9 回貸付債権担保S種住宅金融 公庫債券	33,927,000	34,595,022	
2 回貸付債権担保S種住宅金融 支援機構債券	36,051,000	37,039,157	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	12,015,000	12,373,767	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	57,800,000	59,140,381	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	34,557,000	35,467,922	
1 回貸付債権担保住宅金融支援 機構債券	56,835,000	58,045,585	
4 回貸付債権担保住宅金融支援 機構債券	11,787,000	12,055,861	
2 7 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	19,772,000	20,985,012	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	120,945,000	129,763,099	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	187,992,000	198,780,860	
3 8 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	26,172,000	27,640,249	
4 9 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	23,532,000	24,830,260	
5 2 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	29,934,000	31,555,225	
5 3 回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	31,413,000	33,136,003	

6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,545,000	40,631,440	
6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,016,000	89,187,735	
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,055,000	38,882,182	
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,544,000	45,365,445	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,056,000	45,939,394	
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,046,000	50,104,771	
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,202,000	52,037,385	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,815,000	57,082,000	
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,380,000	64,313,156	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,573,000	67,094,575	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,832,000	238,603,503	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,434,000	81,636,488	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,226,000	81,481,536	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,070,000	81,271,850	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,690,000	253,135,722	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	250,053,000	253,328,694	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,314,000	171,559,103	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,965,000	256,941,469	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	254,172,000	257,242,397	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	439,305,000	446,733,647	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,832,000	90,439,264	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,323,000	302,317,544	
2 1 回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,345,000	
い第828号 利付商工債	100,000,000	100,229,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	100,123,000	
3 4 2 回 利附信金中金債(5年)	100,000,000	100,140,000	

	369回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	400,244,000	
	7回 広島県・広島市折半保証 広島高速道路債	100,000,000	101,599,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	116,798,000	
	18回 国際協力機構債	100,000,000	101,664,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,294,000	
	77回 東日本高速道路社債	300,000,000	300,285,000	
	85回 中日本高速道路債	300,000,000	300,255,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	507,020,000	
	71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,687,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設整備 支援機構債	100,000,000	106,214,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設整備 支援機構債	200,000,000	201,070,000	
特殊債券 合計		24,378,593,000	25,966,555,375	
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	303,114,000	
	26回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2018)	100,000,000	100,472,000	
	2回 BPCE SA円貨社債 (ソーシャルボンド)	100,000,000	100,247,000	
	6回 クレディ・アグリコル・ エス・エー円貨社債	200,000,000	203,932,000	
	11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	100,072,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	400,176,000	
	344回 東京交通債券	100,000,000	102,627,000	
	16回 成田国際空港社債	100,000,000	101,711,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	98,214,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	100,270,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	201,692,000	
	56回 中日本高速道路社債	100,000,000	101,753,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	102,132,000	
	33回 西日本高速道路債	300,000,000	302,913,000	
	34回 西日本高速道路債	200,000,000	202,730,000	
	10回 キリンホールディング ス社債	100,000,000	101,863,000	
	9回 野村不動産ホールディ ングス社債	100,000,000	102,123,000	
	12回 セブン&アイ・ホール ディングス社債	100,000,000	102,780,000	
	14回 セブン&アイ・ホール ディングス社債	200,000,000	200,942,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	302,937,000	
	42回 王子ホールディングス 社債	200,000,000	200,152,000	
	49回 住友化学社債	100,000,000	102,276,000	

19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,545,000	
6回 JXホールディングス社債	100,000,000	102,096,000	
14回 プリチストン社債	300,000,000	304,020,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	101,651,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	101,059,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	201,842,000	
29回 三菱重工業社債	100,000,000	101,714,000	
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	101,276,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,182,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,436,000	
26回 トヨタ自動車	200,000,000	200,326,000	
94回 丸紅社債	100,000,000	101,307,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	104,025,000	
47回 住友商事社債	100,000,000	101,705,000	
48回 クレディセゾン社債	100,000,000	102,130,000	
57回 東京三菱銀行社債	300,000,000	308,334,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	112,084,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	110,232,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	202,994,000	
10回 セブン銀行社債	100,000,000	101,186,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	302,784,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	405,404,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	100,840,000	
47回 日立キャピタル社債	200,000,000	202,696,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	302,619,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	201,770,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	305,421,000	
50回 野村ホールディングス社債	100,000,000	100,087,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	106,990,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	101,116,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	202,192,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	107,923,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	101,175,000	
21回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,377,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	323,592,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	217,132,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	116,911,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	236,048,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	114,351,000	

125回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,762,000	
147回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	101,171,000	
160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,455,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,173,000	
21回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,340,000	
70回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,383,000	
71回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,368,000	
74回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,625,000	
9回	東海旅客鉄道社債	110,000,000	112,247,300	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	304,863,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	209,658,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,793,000	
32回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,581,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	133,572,000	
47回	東京地下鉄社債	100,000,000	96,622,000	
30回	光通信社債	200,000,000	203,198,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,430,000	
527回	中部電力社債	100,000,000	104,451,000	
497回	関西電力社債	100,000,000	103,539,000	
508回	関西電力社債	300,000,000	304,980,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	202,338,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	408,988,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	101,272,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	101,863,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	104,629,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	104,315,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	410,760,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	100,892,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	200,996,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	203,676,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	205,502,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	410,392,000	
428回	九州電力社債	100,000,000	102,607,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	102,410,000	
321回	北海道電力社債	261,000,000	268,154,010	
340回	北海道電力社債	300,000,000	305,322,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	205,616,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	215,242,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	306,645,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	101,418,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	305,580,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	204,188,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	100,019,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	96,420,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	102,082,000	
30回	大阪瓦斯社債	100,000,000	101,046,000	
27回	NTTデータ社債	200,000,000	203,096,000	
5回	ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,096,000	



	7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	203,694,000	
	8回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	207,324,000	
社債券 合計		18,591,000,000	19,066,493,310	
合計			498,419,989,609	

## 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)

2021年7月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,151,559,802
株式	390,836,860,540
派生商品評価勘定	16,970,240
未収入金	32,222,584
未収配当金	411,350,881
前払金	85,952,000
差入委託証拠金	376,740,000
流動資産合計	400,911,656,047
資産合計	
400,911,656,047	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	531,566,000
流動負債合計	531,566,000
負債合計	
531,566,000	
純資産の部	
元本等	
元本	125,027,618,245
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	275,352,471,802
元本等合計	400,380,090,047
純資産合計	
400,380,090,047	
負債純資産合計	
400,911,656,047	

## 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1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年7月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	104,131,508,084円
同期中追加設定元本額	66,237,772,333円
同期中一部解約元本額	45,341,662,172円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	638,707,013円
MHAM TOPIXオープン	2,751,539,482円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,801,168,320円
One DC 国内株式インデックスファンド	17,807,259,600円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,436,726,433円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,203,380円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	12,388,917円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	11,430,432円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,863,380円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,768,510円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,095,593円
たわらノーロード TOPIX	1,065,876,218円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	804,262,507円
たわらノーロード バランス(堅実型)	30,882,023円
たわらノーロード バランス(標準型)	187,456,934円
たわらノーロード バランス(積極型)	287,180,584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)	2,212,375円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	123,083,901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)	291,070,839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)	199,668,217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)	285,143,158円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	647,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,808,515円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	16,212,960円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,445,906円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,083,472円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	34,240,725,007円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	1,011,265,097円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	3,353,144,978円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	3,497,163,456円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	330,695,046円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,126,818,055円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,095,150,957円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,447,514円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,023,706,018円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,322,288円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	302,674,443円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	281,189,463円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	502,891,013円
投資のソムリエ	16,950,643,065円
クルーズコントロール	466,515,120円
投資のソムリエ< D C年金>	885,241,507円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	287,321,539円
4資産分散投資・ハイクラス< D C年金>	430,444,520円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	5,192,490円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	13,570,602円
投資のソムリエ< D C年金> リスク抑制型	491,370,494円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,969,476,714円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	27,147,702円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	13,059,857円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	4,650,838円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	61,188,009円
4資産分散投資・スタンダード< D C年金>	136,203,297円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,075,376,269円
9資産分散投資・スタンダード< D C年金>	263,259,339円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	20,598,174円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,974,549円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,477,428円
4資産分散投資・ミドルクラス< D C年金>	33,560,966円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	91,224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)	78,660,950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)	95,654,616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)	68,715,256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)	48,500,722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)	76,838,015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)	243,059,805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)	88,868,794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)	87,327,181円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	445,024,006円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	36,402,733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)	220,053,523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)	128,594,604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)	62,088,694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)	107,563,107円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,903,404円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	29,114,940円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,537,351円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,985,304円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,035,929円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	37,989,175円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	610,743,140円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	673,460,189円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,920,690,751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)	58,052,580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)	34,120,030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)	328,980,745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)	85,204,299円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,555,801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)	411,282,270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)	23,151,048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)	86,804,876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)	206,870,261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)	287,247,274円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	40,840,143円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	18,743,216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)	321,266,809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)	992,662,363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)	1,314,318,490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)	52,594,563円
動的パッケージファンド<DC年金>	20,462,695円
コア資産形成ファンド	16,425,966円
MHAMトピックスファンド	645,976,041円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	69,950,091円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,961,129,299円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,153,424,042円
計	125,027,618,245円
2. 受益権の総数	125,027,618,245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1月13日 至 2021年7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	4,062,599,737	
合計	4,062,599,737	

(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(2021年2月9日から2021年7月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年7月12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	7,823,907,100	-		7,841,010,000
合計	7,823,907,100	-		7,841,010,000
				17,102,900
				17,102,900

(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)

2021年7月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.2023円 (32,023円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年7月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	6,700	2,912.00	19,510,400	
日本水産	183,700	537.00	98,646,900	
マルハニチロ	30,800	2,379.00	73,273,200	
ハウスイ	900	940.00	846,000	
雪国まいたけ	15,900	1,682.00	26,743,800	
カネコ種苗	5,800	1,467.00	8,508,600	
サカタのタネ	23,600	3,755.00	88,618,000	
ホクト	16,800	1,937.00	32,541,600	
ホクリヨウ	2,900	823.00	2,386,700	
ヒノキヤグループ	4,800	2,383.00	11,438,400	
ショーボンドホールディングス	28,300	4,740.00	134,142,000	
ミライト・ホールディングス	68,800	2,073.00	142,622,400	
タマホーム	12,200	2,336.00	28,499,200	
サンヨーホームズ	2,800	721.00	2,018,800	
日本アクア	7,800	536.00	4,180,800	
ファーストコーポレーション	6,100	786.00	4,794,600	

ベステラ	3,700	1,470.00	5,439,000
Robot Home	38,300	232.00	8,885,600
キャンディル	3,400	582.00	1,978,800
スペースバリューホールディングス	24,000	740.00	17,760,000
住石ホールディングス	34,100	128.00	4,364,800
日鉄鉱業	4,600	5,910.00	27,186,000
三井松島ホールディングス	8,300	1,015.00	8,424,500
I N P E X	728,300	813.00	592,107,900
石油資源開発	26,100	1,912.00	49,903,200
K & Oエナジーグループ	9,400	1,319.00	12,398,600
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,180.00	4,484,000
第一カッター興業	4,800	1,350.00	6,480,000
明豊ファシリティワークス	6,500	874.00	5,681,000
安藤・間	126,900	860.00	109,134,000
東急建設	58,200	813.00	47,316,600
コムシスホールディングス	70,200	3,085.00	216,567,000
ビーアールホールディングス	23,200	477.00	11,066,400
高松コンストラクショングループ	12,600	2,049.00	25,817,400
東建コーポレーション	6,100	10,340.00	63,074,000
ソネック	2,000	1,016.00	2,032,000
ヤマウラ	8,700	911.00	7,925,700
オリエンタル白石	66,400	281.00	18,658,400
大成建設	142,400	3,790.00	539,696,000
大林組	457,400	914.00	418,063,600
清水建設	428,900	891.00	382,149,900
飛鳥建設	12,900	1,089.00	14,048,100
長谷工コーポレーション	149,700	1,506.00	225,448,200
松井建設	18,400	798.00	14,683,200
銭高組	1,400	4,065.00	5,691,000
鹿島建設	335,100	1,439.00	482,208,900
不動テトラ	11,200	1,850.00	20,720,000
大末建設	6,100	987.00	6,020,700
鉄建建設	9,200	1,894.00	17,424,800
西松建設	32,500	3,660.00	118,950,000
三井住友建設	110,400	492.00	54,316,800
大豊建設	10,100	4,275.00	43,177,500
前田建設工業	114,600	973.00	111,505,800
佐田建設	8,800	482.00	4,241,600
ナカノフドー建設	12,100	422.00	5,106,200
奥村組	25,000	2,979.00	74,475,000
東鉄工業	19,700	2,363.00	46,551,100
イチケン	3,000	1,868.00	5,604,000
富士ピー・エス	6,200	550.00	3,410,000
浅沼組	5,400	4,685.00	25,299,000
戸田建設	190,000	774.00	147,060,000
熊谷組	21,000	2,854.00	59,934,000
北野建設	2,500	2,333.00	5,832,500
植木組	3,700	1,456.00	5,387,200
矢作建設工業	20,300	731.00	14,839,300
ピーエス三菱	15,100	619.00	9,346,900



日本ハウスホールディングス	32,300	404.00	13,049,200	
大東建託	50,100	13,060.00	654,306,000	
新日本建設	19,500	859.00	16,750,500	
N I P P O	37,800	3,140.00	118,692,000	
東亜道路工業	2,800	4,635.00	12,978,000	
前田道路	28,300	2,205.00	62,401,500	
日本道路	4,500	8,000.00	36,000,000	
東亜建設工業	12,400	2,497.00	30,962,800	
日本国土開発	45,000	585.00	26,325,000	
若築建設	8,300	1,672.00	13,877,600	
東洋建設	51,400	580.00	29,812,000	
五洋建設	194,400	772.00	150,076,800	
世紀東急工業	21,900	873.00	19,118,700	
福田組	5,200	4,940.00	25,688,000	
日本ドライケミカル	3,500	1,800.00	6,300,000	
住友林業	107,500	2,037.00	218,977,500	
日本基礎技術	14,500	572.00	8,294,000	
巴コーポレーション	20,300	381.00	7,734,300	
大和ハウス工業	422,500	3,381.00	1,428,472,500	
ライト工業	26,300	1,905.00	50,101,500	
積水ハウス	496,000	2,293.00	1,137,328,000	
日特建設	12,200	770.00	9,394,000	
北陸電気工事	8,000	1,295.00	10,360,000	
ユアテック	26,200	737.00	19,309,400	
日本リーテック	9,400	1,685.00	15,839,000	
四電工	2,100	3,005.00	6,310,500	
中電工	21,000	2,301.00	48,321,000	
関電工	74,600	895.00	66,767,000	
きんでん	93,600	1,836.00	171,849,600	
東京エネシス	15,200	959.00	14,576,800	
トーエネック	4,600	3,785.00	17,411,000	
住友電設	13,000	2,307.00	29,991,000	
日本電設工業	25,000	1,936.00	48,400,000	
協和エクシオ	69,200	2,747.00	190,092,400	
新日本空調	12,200	2,112.00	25,766,400	
日本工営	8,800	3,080.00	27,104,000	
九電工	32,300	3,645.00	117,733,500	
三機工業	32,500	1,448.00	47,060,000	
日揮ホールディングス	152,500	1,028.00	156,770,000	
中外炉工業	4,800	1,933.00	9,278,400	
ヤマト	14,800	816.00	12,076,800	
太平電業	10,300	2,677.00	27,573,100	
高砂熱学工業	41,400	1,918.00	79,405,200	
三晃金属工業	1,900	2,375.00	4,512,500	
N E C ネットズエスアイ	47,200	1,796.00	84,771,200	
朝日工業社	2,800	3,210.00	8,988,000	
明星工業	29,800	745.00	22,201,000	
大気社	22,100	3,415.00	75,471,500	
ダイダン	10,300	2,618.00	26,965,400	
日比谷総合設備	15,200	1,838.00	27,937,600	

ニッポン	43,300	1,582.00	68,500,600
日清製粉グループ本社	165,300	1,674.00	276,712,200
日東富士製粉	900	6,930.00	6,237,000
昭和産業	12,600	3,045.00	38,367,000
鳥越製粉	13,200	791.00	10,441,200
中部飼料	18,100	1,153.00	20,869,300
フィード・ワン	20,100	745.00	14,974,500
東洋精糖	2,100	1,198.00	2,515,800
日本甜菜製糖	7,900	1,659.00	13,106,100
D M三井製糖ホールディングス	12,000	1,864.00	22,368,000
塩水港精糖	17,600	222.00	3,907,200
日新製糖	5,700	1,703.00	9,707,100
L I F U L L	48,700	345.00	16,801,500
ミクシィ	35,400	2,807.00	99,367,800
ジェイエシーリクルートメント	9,200	1,814.00	16,688,800
日本M&Aセンター	228,500	3,110.00	710,635,000
メンバーズ	3,900	3,410.00	13,299,000
中広	1,400	360.00	504,000
U Tグループ	20,100	3,425.00	68,842,500
アイティメディア	4,700	2,079.00	9,771,300
タケエイ	15,800	1,734.00	27,397,200
E・Jホールディングス	5,300	1,095.00	5,803,500
夢真ビーネックスグループ	34,700	1,314.00	45,595,800
コシダカホールディングス	37,100	628.00	23,298,800
アルトナー	3,300	846.00	2,791,800
パソナグループ	15,200	2,338.00	35,537,600
C D S	2,900	1,550.00	4,495,000
リンクアンドモチベーション	25,500	878.00	22,389,000
G C A	18,100	1,091.00	19,747,100
エス・エム・エス	47,200	3,375.00	159,300,000
サニーサイドアップグループ	5,000	738.00	3,690,000
パーソルホールディングス	139,500	2,290.00	319,455,000
リニカル	7,900	989.00	7,813,100
クックパッド	43,500	253.00	11,005,500
エスクリ	4,700	479.00	2,251,300
アイ・ケイ・ケイ	6,700	680.00	4,556,000
森永製菓	34,400	3,675.00	126,420,000
中村屋	2,900	3,840.00	11,136,000
江崎グリコ	40,300	4,215.00	169,864,500
名糖産業	6,700	1,591.00	10,659,700
井村屋グループ	8,300	2,335.00	19,380,500
不二家	9,400	2,222.00	20,886,800
山崎製パン	109,700	1,551.00	170,144,700
第一屋製パン	3,300	939.00	3,098,700
モロゾフ	2,100	5,350.00	11,235,000
亀田製菓	8,500	4,595.00	39,057,500
寿スピリッツ	14,200	7,700.00	109,340,000
カルビー	66,600	2,578.00	171,694,800
森永乳業	26,800	5,980.00	160,264,000
六甲バター	10,000	1,533.00	15,330,000

ヤクルト本社	100,500	6,460.00	649,230,000
明治ホールディングス	96,900	6,800.00	658,920,000
雪印メグミルク	35,300	2,092.00	73,847,600
プリマハム	20,500	2,976.00	61,008,000
日本ハム	56,000	4,325.00	242,200,000
林兼産業	4,000	582.00	2,328,000
丸大食品	14,800	1,729.00	25,589,200
S Foods	13,200	3,355.00	44,286,000
柿安本店	4,800	2,509.00	12,043,200
伊藤ハム米久ホールディングス	94,800	731.00	69,298,800
学情	4,800	1,338.00	6,422,400
スタジオアリス	6,800	2,542.00	17,285,600
クロスキャット	3,500	974.00	3,409,000
シミックホールディングス	6,700	1,571.00	10,525,700
エブコ	3,300	875.00	2,887,500
システナ	51,200	2,207.00	112,998,400
NJS	3,300	1,930.00	6,369,000
デジタルアーツ	8,300	8,370.00	69,471,000
日鉄ソリューションズ	21,300	3,505.00	74,656,500
総合警備保障	55,600	5,020.00	279,112,000
キューブシステム	7,500	1,024.00	7,680,000
いちご	162,100	364.00	59,004,400
WOW WORLD	2,200	1,963.00	4,318,600
日本駐車場開発	155,700	168.00	26,157,600
コア	6,100	1,446.00	8,820,600
カカクコム	103,100	3,240.00	334,044,000
アイロムグループ	4,800	2,019.00	9,691,200
セントケア・ホールディング	10,300	985.00	10,145,500
サイネックス	2,800	700.00	1,960,000
ルネサンス	9,300	1,337.00	12,434,100
ディップ	21,600	3,545.00	76,572,000
SBSホールディングス	10,900	3,305.00	36,024,500
デジタルホールディングス	9,600	2,233.00	21,436,800
新日本科学	16,800	1,031.00	17,320,800
キャリアデザインセンター	2,900	1,078.00	3,126,200
ベネフィット・ワン	51,000	3,435.00	175,185,000
エムスリー	245,900	7,807.00	1,919,741,300
ツカダ・グローバルホールディング	12,200	385.00	4,697,000
プラス	1,500	520.00	780,000
アウトソーシング	80,000	2,138.00	171,040,000
ウェルネット	14,400	525.00	7,560,000
ワールドホールディングス	4,800	3,190.00	15,312,000
ディー・エヌ・エー	59,000	2,264.00	133,576,000
博報堂DYホールディングス	193,800	1,726.00	334,498,800
ぐるなび	24,300	544.00	13,219,200
タカミヤ	17,400	525.00	9,135,000
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	953.00	10,387,700
ファンコミュニケーションズ	38,200	398.00	15,203,600
ライク	3,500	2,147.00	7,514,500
ビジネス・ブレークスルー	6,300	418.00	2,633,400

エスプール	35,800	1,033.00	36,981,400
WDBホールディングス	6,500	3,050.00	19,825,000
手間いらず	1,800	6,390.00	11,502,000
ティア	8,700	469.00	4,080,300
CDG	1,500	1,590.00	2,385,000
アドウェイズ	22,000	824.00	18,128,000
パリュコマース	9,400	3,115.00	29,281,000
インフォマート	141,100	938.00	132,351,800
サッポロホールディングス	50,100	2,344.00	117,434,400
アサヒグループホールディングス	320,000	5,106.00	1,633,920,000
麒麟ホールディングス	621,000	2,111.50	1,311,241,500
宝ホールディングス	108,300	1,368.00	148,154,400
オエノンホールディングス	42,400	378.00	16,027,200
養命酒製造	4,700	1,823.00	8,568,100
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	111,800	1,749.00	195,538,200
サントリー食品インターナショナル	98,000	4,155.00	407,190,000
ダイドグループホールディングス	8,500	5,000.00	42,500,000
伊藤園	44,600	6,650.00	296,590,000
キーコーヒー	14,800	2,136.00	31,612,800
ユニカフェ	4,700	996.00	4,681,200
ジャパンフーズ	1,800	1,225.00	2,205,000
日清オイリオグループ	18,800	3,060.00	57,528,000
不二製油グループ本社	35,800	2,540.00	90,932,000
かどや製油	1,100	4,080.00	4,488,000
J-オイルミルズ	13,800	1,863.00	25,709,400
ローソン	36,100	5,320.00	192,052,000
サンエー	10,900	4,155.00	45,289,500
カワチ薬品	10,100	2,196.00	22,179,600
エービーシー・マート	22,300	6,410.00	142,943,000
ハードオフコーポレーション	6,700	777.00	5,205,900
高千穂交易	5,800	1,148.00	6,658,400
アスクル	23,600	1,634.00	38,562,400
ゲオホールディングス	19,400	1,228.00	23,823,200
アダストリア	19,800	1,979.00	39,184,200
ジーフット	9,700	416.00	4,035,200
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,600	425.00	1,105,000
オルバヘルスケアホールディングス	2,000	1,691.00	3,382,000
伊藤忠食品	2,900	5,320.00	15,428,000
くら寿司	16,600	4,175.00	69,305,000
キャンドウ	6,700	1,913.00	12,817,100
エレマテック	11,600	1,253.00	14,534,800
アイケイ	2,900	775.00	2,247,500
パルグループホールディングス	12,800	1,704.00	21,811,200
JALUX	4,000	1,801.00	7,204,000
エディオン	60,800	1,093.00	66,454,400
あらた	11,600	4,310.00	49,996,000
サーラコーポレーション	29,700	613.00	18,206,100
ワッツ	6,500	914.00	5,941,000
トーメンデバイス	1,900	4,105.00	7,799,500

ハローズ	5,300	2,785.00	14,760,500
J Pホールディングス	39,800	273.00	10,865,400
フジオフードグループ本社	12,400	1,305.00	16,182,000
あみやき亭	2,900	2,945.00	8,540,500
東京エレクトロン デバイス	4,800	5,410.00	25,968,000
ひらまつ	23,200	210.00	4,872,000
フィールズ	13,000	536.00	6,968,000
双日	792,000	338.00	267,696,000
アルフレッサ ホールディングス	148,800	1,716.00	255,340,800
大黒天物産	4,600	6,320.00	29,072,000
ハニーズホールディングス	11,300	1,213.00	13,706,900
ファーマライズホールディングス	3,800	736.00	2,796,800
キッコーマン	105,000	7,110.00	746,550,000
味の素	348,300	2,879.50	1,002,929,850
ブルドックソース	6,700	2,355.00	15,778,500
キューピー	81,600	2,486.00	202,857,600
ハウス食品グループ本社	54,800	3,450.00	189,060,000
カゴメ	59,800	2,899.00	173,360,200
焼津水産化学工業	6,000	964.00	5,784,000
アリアケジャパン	13,800	7,030.00	97,014,000
ピエトロ	1,400	1,721.00	2,409,400
エバラ食品工業	2,900	2,634.00	7,638,600
やまみ	1,200	1,921.00	2,305,200
ニチレイ	69,800	2,951.00	205,979,800
横浜冷凍	38,000	900.00	34,200,000
東洋水産	75,200	4,235.00	318,472,000
イートアンドホールディングス	5,000	1,955.00	9,775,000
大冷	1,800	2,004.00	3,607,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,300	742.00	6,158,600
日清食品ホールディングス	57,500	7,920.00	455,400,000
永谷園ホールディングス	7,300	2,169.00	15,833,700
一正蒲鉾	5,000	932.00	4,660,000
フジッコ	16,100	1,930.00	31,073,000
ロック・フィールド	16,000	1,523.00	24,368,000
日本たばこ産業	785,100	2,120.00	1,664,412,000
ケンコーマヨネーズ	9,100	1,548.00	14,086,800
わらべや日洋ホールディングス	9,600	2,380.00	22,848,000
なとり	8,500	1,941.00	16,498,500
イフジ産業	2,800	954.00	2,671,200
ピクルスコーポレーション	3,300	3,425.00	11,302,500
ファーマフーズ	13,800	2,960.00	40,848,000
北の達人コーポレーション	51,000	478.00	24,378,000
ユーグレナ	72,900	1,073.00	78,221,700
紀文食品	8,600	1,331.00	11,446,600
スター・マイカ・ホールディングス	7,500	1,197.00	8,977,500
S R Eホールディングス	2,100	7,390.00	15,519,000
A Dワークスグループ	27,600	157.00	4,333,200
片倉工業	19,400	1,490.00	28,906,000
ゲンゼ	10,500	4,670.00	49,035,000
ヒューリック	305,200	1,275.00	389,130,000

神栄	1,700	1,250.00	2,125,000
ラサ商事	7,900	902.00	7,125,800
アルペン	11,000	3,050.00	33,550,000
ハブ	4,700	700.00	3,290,000
ラクーンホールディングス	10,300	2,357.00	24,277,100
クオールホールディングス	19,300	1,512.00	29,181,600
アルコニックス	15,300	1,475.00	22,567,500
神戸物産	99,100	3,845.00	381,039,500
ソリトンシステムズ	7,100	1,584.00	11,246,400
ジーンズホールディングス	9,700	8,170.00	79,249,000
ビックカメラ	85,400	1,135.00	96,929,000
DCMホールディングス	88,800	1,084.00	96,259,200
ペッパーフードサービス	14,000	430.00	6,020,000
ハイパー	2,600	544.00	1,414,400
Monotaro	204,300	2,639.00	539,147,700
東京一番フーズ	2,600	593.00	1,541,800
DDホールディングス	5,700	524.00	2,986,800
あいホールディングス	20,400	2,167.00	44,206,800
ディービーエックス	4,700	1,000.00	4,700,000
きちりホールディングス	4,200	596.00	2,503,200
アークランドサービスホールディングス	12,200	2,223.00	27,120,600
J.フロントリテイリング	171,500	1,025.00	175,787,500
ドトール・日レスホールディングス	23,000	1,759.00	40,457,000
マツモトキヨシホールディングス	59,300	4,850.00	287,605,000
ブロンコビリー	7,500	2,402.00	18,015,000
ZOZO	84,800	3,535.00	299,768,000
トレジャー・ファクトリー	4,300	994.00	4,274,200
物語コーポレーション	7,600	7,390.00	56,164,000
ココカラファイン	12,800	8,180.00	104,704,000
三越伊勢丹ホールディングス	251,200	823.00	206,737,600
東洋紡	56,500	1,319.00	74,523,500
ユニチカ	42,200	336.00	14,179,200
富士紡ホールディングス	6,700	3,870.00	25,929,000
日清紡ホールディングス	89,000	944.00	84,016,000
倉敷紡績	13,200	1,958.00	25,845,600
ダイワボウホールディングス	65,600	2,015.00	132,184,000
シキボウ	8,200	942.00	7,724,400
日東紡績	21,500	3,210.00	69,015,000
トヨタ紡織	42,600	2,238.00	95,338,800
マクニカ・富士エレホールディングス	34,300	2,617.00	89,763,100
Hamee	3,400	1,479.00	5,028,600
ラクト・ジャパン	6,300	2,755.00	17,356,500
ウエルシアホールディングス	75,900	3,375.00	256,162,500
クリエイトSDホールディングス	21,000	3,200.00	67,200,000
グリムス	4,100	1,971.00	8,081,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,400	754.00	19,151,600
八洲電機	11,200	970.00	10,864,000
メディアスホールディングス	8,300	1,046.00	8,681,800

レスターホールディングス	15,200	1,950.00	29,640,000
ジューテックホールディングス	2,900	1,038.00	3,010,200
丸善CHIホールディングス	18,600	402.00	7,477,200
大光	6,100	685.00	4,178,500
OCHIホールディングス	4,300	1,282.00	5,512,600
TOKAIホールディングス	69,900	913.00	63,818,700
黒谷	4,000	905.00	3,620,000
ミサワ	2,800	699.00	1,957,200
ティーライフ	2,100	1,556.00	3,267,600
Cominix	2,100	730.00	1,533,000
エー・ピーホールディングス	2,200	500.00	1,100,000
三洋貿易	14,300	1,264.00	18,075,200
チムニー	4,500	1,420.00	6,390,000
シュッピン	10,000	1,070.00	10,700,000
ビューティガレージ	2,500	4,470.00	11,175,000
オイシックス・ラ・大地	18,900	4,250.00	80,325,000
ウイン・パートナーズ	10,400	1,015.00	10,556,000
ネクステージ	24,700	2,170.00	53,599,000
ジョイフル本田	42,200	1,376.00	58,067,200
鳥貴族ホールディングス	4,100	1,866.00	7,650,600
ホットランド	10,700	1,331.00	14,241,700
すかいらくホールディングス	180,100	1,514.00	272,671,400
SFPホールディングス	7,100	1,501.00	10,657,100
綿半ホールディングス	10,800	1,238.00	13,370,400
日本毛織	47,200	981.00	46,303,200
ダイトウボウ	20,600	102.00	2,101,200
トーア紡コーポレーション	5,000	444.00	2,220,000
ダイドーリミテッド	20,100	176.00	3,537,600
ヨシックスホールディングス	2,900	2,350.00	6,815,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	42,000	1,019.00	42,798,000
三栄建築設計	5,800	2,044.00	11,855,200
野村不動産ホールディングス	82,500	2,779.00	229,267,500
三重交通グループホールディングス	29,400	472.00	13,876,800
サムティ	20,200	2,297.00	46,399,400
ディア・ライフ	20,300	476.00	9,662,800
コーセーアールイー	4,500	660.00	2,970,000
日本商業開発	9,000	1,719.00	15,471,000
プレサンスコーポレーション	23,600	1,551.00	36,603,600
フィル・カンパニー	2,800	2,695.00	7,546,000
THEグローバル社	7,700	226.00	1,740,200
ハウスコム	1,500	1,235.00	1,852,500
日本管理センター	7,500	1,300.00	9,750,000
サンセイランディック	4,300	874.00	3,758,200
エストラスト	1,500	676.00	1,014,000
フージャースホールディングス	23,600	747.00	17,629,200
オープンハウス	45,300	5,320.00	240,996,000
東急不動産ホールディングス	391,000	655.00	256,105,000
飯田グループホールディングス	120,000	2,670.00	320,400,000
イーランド	2,800	1,033.00	2,892,400

ムゲンエステート	9,400	509.00	4,784,600
帝国繊維	16,100	2,115.00	34,051,500
日本コークス工業	123,400	101.00	12,463,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,300	1,762.00	12,862,600
ミタチ産業	3,600	808.00	2,908,800
B E E N O S	6,700	3,530.00	23,651,000
あさひ	10,700	1,359.00	14,541,300
日本調剤	8,700	1,670.00	14,529,000
コスモス薬品	14,800	16,220.00	240,056,000
シップヘルスケアホールディングス	50,600	2,709.00	137,075,400
トーエル	6,700	827.00	5,540,900
ソフトクリエイトホールディングス	5,800	2,744.00	15,915,200
オンリー	3,000	474.00	1,422,000
セブン&アイ・ホールディングス	562,000	5,088.00	2,859,456,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	66,600	983.00	65,467,800
明治電機工業	3,800	1,407.00	5,346,600
ツルハホールディングス	31,400	12,550.00	394,070,000
デリカフーズホールディングス	6,400	652.00	4,172,800
スターティアホールディングス	2,800	2,017.00	5,647,600
サンマルクホールディングス	11,700	1,603.00	18,755,100
フェリシモ	3,000	1,693.00	5,079,000
トリドールホールディングス	35,600	1,904.00	67,782,400
帝人	134,500	1,649.00	221,790,500
東レ	1,034,500	723.00	747,943,500
クラレ	224,900	1,018.00	228,948,200
旭化成	947,000	1,210.50	1,146,343,500
サカイオーベックス	3,700	3,100.00	11,470,000
T O K Y O B A S E	13,000	686.00	8,918,000
稲葉製作所	8,300	1,536.00	12,748,800
宮地エンジニアリンググループ	4,700	2,456.00	11,543,200
トーカロ	37,200	1,416.00	52,675,200
アルファ	5,500	1,135.00	6,242,500
S U M C O	184,500	2,713.00	500,548,500
川田テクノロジーズ	2,900	3,725.00	10,802,500
R S T e c h n o l o g i e s	4,700	6,250.00	29,375,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,270.00	3,270,000
信和	7,800	706.00	5,506,800
ビーロッド	6,900	573.00	3,953,700
ファーストブラザーズ	2,900	1,078.00	3,126,200
ハウズドゥ	7,100	1,007.00	7,149,700
シーアールイー	3,500	1,587.00	5,554,500
プロパティエージェント	2,500	2,559.00	6,397,500
ケイアイスター不動産	4,500	5,220.00	23,490,000
アグレ都市デザイン	2,700	1,000.00	2,700,000
グッドコムアセット	6,800	1,458.00	9,914,400
ジェイ・エス・ビー	2,800	3,905.00	10,934,000
テンポイノベーション	4,000	895.00	3,580,000
グローバル・リンク・マネジメント	2,300	870.00	2,001,000
住江織物	2,800	2,039.00	5,709,200



日本フェルト	6,900	442.00	3,049,800
イチカワ	1,500	1,346.00	2,019,000
エコナックホールディングス	22,100	90.00	1,989,000
日東製網	1,500	1,524.00	2,286,000
芦森工業	2,800	1,188.00	3,326,400
アツギ	11,300	622.00	7,028,600
ウイルプラスホールディングス	2,500	1,038.00	2,595,000
JMホールディングス	10,900	2,134.00	23,260,600
コメダホールディングス	31,500	2,084.00	65,646,000
サツドラホールディングス	1,900	2,011.00	3,820,900
アレンザホールディングス	10,500	1,258.00	13,209,000
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,863.00	6,893,100
パロックジャパンリミテッド	10,400	819.00	8,517,600
クスリのアオキホールディングス	14,400	7,300.00	105,120,000
ダイニック	4,600	754.00	3,468,400
共和レザー	8,200	716.00	5,871,200
ピーバンドットコム	1,900	787.00	1,495,300
力の源ホールディングス	5,900	619.00	3,652,100
FOOD & LIFE COMPANIES	84,000	4,240.00	356,160,000
アセンテック	3,400	1,205.00	4,097,000
セーレン	35,300	2,163.00	76,353,900
ソトー	5,000	804.00	4,020,000
東海染工	1,500	1,138.00	1,707,000
小松マテーレ	23,400	929.00	21,738,600
ワコールホールディングス	35,600	2,544.00	90,566,400
ホギメディカル	19,300	3,455.00	66,681,500
クラウドシアホールディングス	2,900	286.00	829,400
T S Iホールディングス	43,200	379.00	16,372,800
マツオカコーポレーション	4,600	1,658.00	7,626,800
ワールド	18,600	1,463.00	27,211,800
T I S	143,200	2,913.00	417,141,600
J N Sホールディングス	6,700	600.00	4,020,000
グリー	87,900	607.00	53,355,300
GMOペパボ	900	4,620.00	4,158,000
コーエーテクモホールディングス	36,800	5,130.00	188,784,000
三菱総合研究所	6,300	4,170.00	26,271,000
ボルテージ	3,500	469.00	1,641,500
電算	1,100	2,321.00	2,553,100
A G S	7,500	883.00	6,622,500
ファインデックス	12,200	1,208.00	14,737,600
ブレインパッド	3,400	4,800.00	16,320,000
K L a b	26,300	638.00	16,779,400
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	19,000	1,071.00	20,349,000
イーブクイニシアティブジャパン	2,500	3,325.00	8,312,500
ネクソン	361,800	2,325.00	841,185,000
アイスタイル	44,300	494.00	21,884,200
エムアップホールディングス	3,500	3,470.00	12,145,000
エイチーム	9,900	1,522.00	15,067,800

エニグモ	13,600	1,440.00	19,584,000
テクノスジャパン	10,900	611.00	6,659,900
e n i s h	6,300	582.00	3,666,600
コロブラ	46,900	815.00	38,223,500
オルトプラス	7,200	414.00	2,980,800
ブロードリーフ	70,900	521.00	36,938,900
クロス・マーケティンググループ	6,900	667.00	4,602,300
デジタルハーツホールディングス	6,500	1,551.00	10,081,500
システム情報	10,700	929.00	9,940,300
メディアドゥ	5,300	4,730.00	25,069,000
じげん	35,300	455.00	16,061,500
ブイキューブ	7,600	2,458.00	18,680,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	644.00	1,803,200
サイバーリンクス	4,700	1,532.00	7,200,400
ディー・エル・イー	9,700	427.00	4,141,900
フィックスターズ	15,300	840.00	12,852,000
C A R T A H O L D I N G S	5,800	1,957.00	11,350,600
オブティム	10,100	2,133.00	21,543,300
セレス	4,700	3,240.00	15,228,000
S H I F T	7,000	20,680.00	144,760,000
特種東海製紙	8,700	4,525.00	39,367,500
ティーガイア	15,300	2,007.00	30,707,100
セック	2,000	2,665.00	5,330,000
日本アジアグループ	12,100	960.00	11,616,000
テクマトリックス	22,100	1,889.00	41,746,900
プロシップ	4,200	1,423.00	5,976,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,400	2,077.00	71,448,800
G M O ペイメントゲートウェイ	27,300	14,090.00	384,657,000
ザッパラス	5,800	516.00	2,992,800
システムリサーチ	4,200	2,248.00	9,441,600
インターネットイニシアティブ	37,900	3,675.00	139,282,500
さくらインターネット	15,100	617.00	9,316,700
ヴィンクス	3,900	949.00	3,701,100
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,900	4,695.00	13,615,500
S R A ホールディングス	7,600	2,742.00	20,839,200
システムインテグレータ	3,900	654.00	2,550,600
朝日ネット	11,900	689.00	8,199,100
e B A S E	16,900	844.00	14,263,600
アバント	15,300	1,672.00	25,581,600
アドソル日進	4,800	2,239.00	10,747,200
O D K ソリューションズ	2,600	794.00	2,064,400
フリービット	8,500	784.00	6,664,000
コムチュア	13,200	2,441.00	32,221,200
サイバーコム	2,700	1,460.00	3,942,000
アステリア	10,300	834.00	8,590,200
アイル	7,900	1,390.00	10,981,000
王子ホールディングス	643,000	642.00	412,806,000
日本製紙	63,000	1,253.00	78,939,000

三菱製紙	21,700	352.00	7,638,400
北越コーポレーション	102,800	600.00	61,680,000
中越パルプ工業	5,700	1,271.00	7,244,700
巴川製紙所	4,100	797.00	3,267,700
大王製紙	69,100	1,838.00	127,005,800
阿波製紙	3,700	402.00	1,487,400
マークラインズ	5,900	2,951.00	17,410,900
メディカル・データ・ビジョン	16,300	2,071.00	33,757,300
gumi	19,600	769.00	15,072,400
ショーケース	3,000	712.00	2,136,000
モバイルファクトリー	3,000	1,141.00	3,423,000
テラスカイ	4,700	2,410.00	11,327,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,400	1,916.00	12,262,400
PCIホールディングス	5,300	1,164.00	6,169,200
パイブドHD	2,900	2,280.00	6,612,000
アイビーシー	2,600	950.00	2,470,000
ネオジャパン	2,800	1,471.00	4,118,800
PR TIMES	2,900	3,310.00	9,599,000
ラクス	43,200	3,415.00	147,528,000
ランドコンピュータ	1,900	1,108.00	2,105,200
ダブルスタンダード	1,800	5,560.00	10,008,000
オーブンドア	8,800	2,336.00	20,556,800
マイネット	4,100	695.00	2,849,500
アカツキ	5,800	3,415.00	19,807,000
ベネフィットジャパン	900	1,982.00	1,783,800
Ubicomホールディングス	3,500	3,715.00	13,002,500
カナミックネットワーク	13,100	627.00	8,213,700
ノムラシステムコーポレーション	6,400	298.00	1,907,200
レンゴー	147,300	916.00	134,926,800
トーモク	8,700	1,937.00	16,851,900
ザ・バック	10,900	2,754.00	30,018,600
チェンジ	26,300	2,754.00	72,430,200
シンクロ・フード	9,000	369.00	3,321,000
オークネット	7,500	1,414.00	10,605,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,800	999.00	1,798,200
セグエグループ	3,400	1,082.00	3,678,800
エイトレッド	2,800	2,286.00	6,400,800
AOI TYO HOLDINGS	2,400	897.00	2,152,800
マクロミル	29,900	842.00	25,175,800
ビーグリー	2,800	1,536.00	4,300,800
オロ	4,500	3,860.00	17,370,000
ユーザーローカル	4,300	2,004.00	8,617,200
テモナ	2,900	1,109.00	3,216,100
ニーズウェル	2,800	631.00	1,766,800
サインポスト	3,100	789.00	2,445,900
昭和電工	108,300	3,265.00	353,599,500
住友化学	1,124,000	571.00	641,804,000
住友精化	6,700	3,680.00	24,656,000
日産化学	78,900	5,350.00	422,115,000

ラサ工業	4,700	1,846.00	8,676,200
クレハ	12,400	6,650.00	82,460,000
多木化学	5,600	5,210.00	29,176,000
テイカ	10,300	1,310.00	13,493,000
石原産業	25,400	1,115.00	28,321,000
片倉コープアグリ	2,900	1,214.00	3,520,600
日本曹達	20,100	3,240.00	65,124,000
東ソー	220,700	1,995.00	440,296,500
トクヤマ	42,300	2,266.00	95,851,800
セントラル硝子	27,100	2,157.00	58,454,700
東亜合成	87,500	1,153.00	100,887,500
大阪ソーダ	14,800	2,424.00	35,875,200
関東電化工業	33,500	1,007.00	33,734,500
デンカ	52,200	3,700.00	193,140,000
イビデン	70,200	6,070.00	426,114,000
信越化学工業	264,200	18,310.00	4,837,502,000
日本カーバイド工業	5,000	1,291.00	6,455,000
電算システムホールディングス	4,600	3,000.00	13,800,000
堺化学工業	10,100	1,871.00	18,897,100
第一稀元素化学工業	14,500	1,793.00	25,998,500
エア・ウォーター	145,600	1,659.00	241,550,400
日本酸素ホールディングス	117,400	2,359.00	276,946,600
日本化学工業	3,900	3,135.00	12,226,500
東邦アセチレン	2,500	1,187.00	2,967,500
日本パーカライジング	71,900	1,136.00	81,678,400
高压ガス工業	22,700	676.00	15,345,200
チタン工業	1,800	1,858.00	3,344,400
四国化成工業	19,300	1,319.00	25,456,700
戸田工業	2,900	2,649.00	7,682,100
ステラ ケミファ	7,600	2,839.00	21,576,400
保土谷化学工業	4,200	3,955.00	16,611,000
日本触媒	26,000	5,280.00	137,280,000
大日精化工業	12,200	2,325.00	28,365,000
カネカ	36,900	4,530.00	167,157,000
協和キリン	146,800	3,990.00	585,732,000
三菱瓦斯化学	143,100	2,341.00	334,997,100
三井化学	123,500	3,680.00	454,480,000
J S R	143,300	3,565.00	510,864,500
東京応化工業	24,600	7,170.00	176,382,000
大阪有機化学工業	13,200	3,730.00	49,236,000
三菱ケミカルホールディングス	955,200	942.30	900,084,960
K Hネオケム	23,500	2,556.00	60,066,000
ダイセル	191,900	928.00	178,083,200
住友ベークライト	22,600	4,895.00	110,627,000
積水化学工業	299,400	1,918.00	574,249,200
日本ゼオン	129,000	1,482.00	191,178,000
アイカ工業	39,600	3,915.00	155,034,000
宇部興産	71,900	2,237.00	160,840,300
積水樹脂	23,500	2,148.00	50,478,000
タキロンシーアイ	31,300	602.00	18,842,600

旭有機材	8,200	1,356.00	11,119,200	
ニチバン	7,600	1,775.00	13,490,000	
リケンテクノス	34,400	589.00	20,261,600	
大倉工業	6,700	2,442.00	16,361,400	
積水化成品工業	19,300	610.00	11,773,000	
群栄化学工業	2,900	2,491.00	7,223,900	
タイガースポリマー	8,200	479.00	3,927,800	
ミライアル	4,600	1,283.00	5,901,800	
ダイキアクシス	5,200	841.00	4,373,200	
ダイキョーニシカワ	29,900	700.00	20,930,000	
竹本容器	5,000	993.00	4,965,000	
森六ホールディングス	7,700	2,294.00	17,663,800	
恵和	2,000	3,485.00	6,970,000	
日本化薬	88,400	1,093.00	96,621,200	
カーリットホールディングス	14,200	746.00	10,593,200	
E P Sホールディングス	2,400	1,795.00	4,308,000	
ソルクシーズ	5,400	958.00	5,173,200	
レグス	3,000	2,631.00	7,893,000	
プレステージ・インターナショナル	52,200	734.00	38,314,800	
フェイス	4,500	714.00	3,213,000	
プロトコーポレーション	16,600	1,368.00	22,708,800	
アミューズ	7,600	2,378.00	18,072,800	
野村総合研究所	248,600	3,640.00	904,904,000	
ドリームインキュベータ	4,400	989.00	4,351,600	
サイバネットシステム	10,300	687.00	7,076,100	
クイック	8,600	1,213.00	10,431,800	
T A C	7,600	232.00	1,763,200	
C Eホールディングス	7,500	566.00	4,245,000	
日本システム技術	2,700	1,507.00	4,068,900	
電通グループ	156,600	4,005.00	627,183,000	
インテージホールディングス	17,800	1,580.00	28,124,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,700	1,000.00	6,700,000	
東邦システムサイエンス	3,600	956.00	3,441,600	
ぴあ	3,400	3,545.00	12,053,000	
イオンファンタジー	5,300	2,154.00	11,416,200	
ソースネクスト	67,700	314.00	21,257,800	
シーティーエス	15,800	835.00	13,193,000	
ネクシィーズグループ	4,500	919.00	4,135,500	
インフォコム	13,100	2,887.00	37,819,700	
メディカルシステムネットワーク	12,700	746.00	9,474,200	
日本精化	10,300	1,607.00	16,552,100	
扶桑化学工業	11,200	4,255.00	47,656,000	
トリケミカル研究所	12,400	3,140.00	38,936,000	
H E R O Z	4,000	2,158.00	8,632,000	
ラクスル	15,700	5,820.00	91,374,000	
I P S	2,700	2,985.00	8,059,500	
F I G	15,700	280.00	4,396,000	
システムサポート	4,200	1,345.00	5,649,000	
A D E K A	65,800	2,123.00	139,693,400	
日油	54,000	5,780.00	312,120,000	

ミヨシ油脂	5,300	1,278.00	6,773,400
新日本理化	23,200	269.00	6,240,800
ハリマ化成グループ	10,800	885.00	9,558,000
イーソル	7,600	1,056.00	8,025,600
アルテリア・ネットワークス	15,900	1,927.00	30,639,300
E D U L A B	1,200	5,370.00	6,444,000
東海ソフト	1,700	1,515.00	2,575,500
ウイングアーク1st	7,600	2,140.00	16,264,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	2,161.00	5,834,700
サーバーワークス	1,000	4,010.00	4,010,000
東名	900	1,063.00	956,700
ヴィッツ	600	2,038.00	1,222,800
トピラシステムズ	1,200	1,310.00	1,572,000
Sansan	12,600	8,720.00	109,872,000
Link-U	900	1,644.00	1,479,600
ギフトィ	8,400	3,695.00	31,038,000
花王	349,400	6,802.00	2,376,618,800
第一工業製薬	4,800	3,220.00	15,456,000
石原ケミカル	3,500	2,154.00	7,539,000
日華化学	5,200	1,329.00	6,910,800
ニイタカ	2,900	2,091.00	6,063,900
三洋化成工業	8,500	5,370.00	45,645,000
ベース	1,400	5,380.00	7,532,000
武田薬品工業	1,213,600	3,698.00	4,487,892,800
アステラス製薬	1,264,700	1,918.50	2,426,326,950
大日本住友製薬	107,900	2,215.00	238,998,500
塩野義製薬	183,300	5,824.00	1,067,539,200
わかもと製薬	17,500	329.00	5,757,500
日本新薬	41,400	8,770.00	363,078,000
バイオフェルミン製薬	2,800	2,993.00	8,380,400
中外製薬	456,300	4,238.00	1,933,799,400
科研製薬	24,900	4,795.00	119,395,500
エーザイ	160,900	10,530.00	1,694,277,000
理研ビタミン	13,900	1,597.00	22,198,300
ロート製薬	69,600	3,020.00	210,192,000
小野薬品工業	335,100	2,524.50	845,959,950
久光製薬	42,400	5,390.00	228,536,000
有機合成薬品工業	11,200	386.00	4,323,200
持田製薬	20,200	3,725.00	75,245,000
参天製薬	254,000	1,541.00	391,414,000
扶桑薬品工業	4,700	2,237.00	10,513,900
日本ケミファ	1,400	2,249.00	3,148,600
ツムラ	48,700	3,470.00	168,989,000
日医工	41,400	862.00	35,686,800
テルモ	447,400	4,412.00	1,973,928,800
H.U.グループホールディングス	38,900	2,832.00	110,164,800
キッセイ薬品工業	26,000	2,219.00	57,694,000
生化学工業	26,000	1,111.00	28,886,000
栄研化学	25,800	2,170.00	55,986,000

日水製薬	5,800	1,006.00	5,834,800
鳥居薬品	9,200	2,444.00	22,484,800
JCRファーマ	41,200	3,660.00	150,792,000
東和薬品	21,000	2,549.00	53,529,000
富士製薬工業	10,000	1,144.00	11,440,000
ゼリア新薬工業	26,600	2,083.00	55,407,800
第一三共	1,146,000	2,309.00	2,646,114,000
キョーリン製薬ホールディングス	32,300	1,804.00	58,269,200
大幸薬品	17,800	965.00	17,177,000
ダイト	9,400	3,465.00	32,571,000
大塚ホールディングス	303,400	4,390.00	1,331,926,000
大正製薬ホールディングス	34,500	6,020.00	207,690,000
ペプチドリーム	76,100	4,910.00	373,651,000
大日本塗料	16,200	857.00	13,883,400
日本ペイントホールディングス	588,700	1,381.00	812,994,700
関西ペイント	160,400	2,783.00	446,393,200
神東塗料	11,300	193.00	2,180,900
中国塗料	34,400	872.00	29,996,800
日本特殊塗料	10,800	1,110.00	11,988,000
藤倉化成	19,600	515.00	10,094,000
太陽ホールディングス	10,700	5,120.00	54,784,000
DIC	60,200	2,763.00	166,332,600
サカタインクス	31,300	1,020.00	31,926,000
東洋インキSCホールディングス	30,100	1,965.00	59,146,500
T&K TOKA	11,500	853.00	9,809,500
アルプス技研	12,500	1,999.00	24,987,500
サニックス	18,800	351.00	6,598,800
ダイオーズ	2,800	1,044.00	2,923,200
日本空調サービス	15,300	725.00	11,092,500
オリエンタルランド	148,200	16,090.00	2,384,538,000
フォーカスシステムズ	9,400	986.00	9,268,400
ダスキン	32,300	2,568.00	82,946,400
パーク24	77,100	2,067.00	159,365,700
明光ネットワークジャパン	17,800	588.00	10,466,400
ファルコホールディングス	6,700	1,684.00	11,282,800
クレスコ	9,700	1,910.00	18,527,000
フジ・メディア・ホールディングス	148,200	1,243.00	184,212,600
秀英予備校	2,900	414.00	1,200,600
田谷	1,800	556.00	1,000,800
ラウンドワン	47,600	1,425.00	67,830,000
リゾートトラスト	63,900	1,868.00	119,365,200
オービック	45,300	20,800.00	942,240,000
ジャストシステム	20,200	6,510.00	131,502,000
TDCソフト	12,700	1,032.00	13,106,400
Zホールディングス	1,966,500	559.70	1,100,650,050
ピー・エム・エル	18,100	3,905.00	70,680,500
トレンドマイクロ	76,300	5,820.00	444,066,000
りらいあコミュニケーションズ	21,100	1,384.00	29,202,400
IDホールディングス	8,200	927.00	7,601,400
リソー教育	70,400	333.00	23,443,200

日本オラクル	29,100	8,230.00	239,493,000
早稲田アカデミー	5,300	934.00	4,950,200
アルファシステムズ	3,700	3,750.00	13,875,000
フューチャー	17,500	1,954.00	34,195,000
CAC Holdings	9,200	1,460.00	13,432,000
SBテクノロジー	5,000	3,030.00	15,150,000
トーセ	3,900	802.00	3,127,800
ユー・エス・エス	156,100	1,889.00	294,872,900
オービックビジネスコンサルタント	14,800	6,510.00	96,348,000
伊藤忠テクノソリューションズ	65,400	3,460.00	226,284,000
アイティフォー	18,800	786.00	14,776,800
東京個別指導学院	12,300	619.00	7,613,700
東計電算	2,200	4,545.00	9,999,000
サイバーエージェント	343,400	2,329.00	799,778,600
楽天グループ	649,500	1,328.00	862,536,000
エクスネット	2,800	1,031.00	2,886,800
クリーク・アンド・リバー社	7,100	1,713.00	12,162,300
モーニングスター	15,300	470.00	7,191,000
テー・オー・ダブリュー	24,900	321.00	7,992,900
大塚商会	77,500	5,830.00	451,825,000
サイボウズ	16,800	2,537.00	42,621,600
山田コンサルティンググループ	8,200	1,200.00	9,840,000
セントラルスポーツ	5,000	2,450.00	12,250,000
パラカ	3,600	1,700.00	6,120,000
電通国際情報サービス	17,700	4,735.00	83,809,500
ACCESS	17,400	887.00	15,433,800
デジタルガレージ	23,500	4,990.00	117,265,000
イーエムシステムズ	23,600	839.00	19,800,400
ウェザーニューズ	4,200	5,610.00	23,562,000
CIJ	9,900	846.00	8,375,400
ビジネスエンジニアリング	1,400	3,185.00	4,459,000
日本エンタープライズ	14,300	213.00	3,045,900
WOWOW	6,700	2,468.00	16,535,600
スカラ	12,800	775.00	9,920,000
インテリジェント ウェイブ	8,500	597.00	5,074,500
フルキャストホールディングス	12,300	2,300.00	28,290,000
エン・ジャパン	24,800	3,920.00	97,216,000
あすか製薬ホールディングス	16,700	965.00	16,115,500
サワイグループホールディングス	32,100	4,730.00	151,833,000
富士フイルムホールディングス	256,600	8,190.00	2,101,554,000
コニカミノルタ	295,800	612.00	181,029,600
資生堂	290,200	8,000.00	2,321,600,000
ライオン	189,600	1,973.00	374,080,800
高砂香料工業	9,100	2,708.00	24,642,800
マンダム	30,400	1,989.00	60,465,600
ミルボン	19,400	6,180.00	119,892,000
ファンケル	53,000	3,570.00	189,210,000
コーセー	27,300	17,580.00	479,934,000
コタ	9,300	1,414.00	13,150,200
シーボン	1,500	1,978.00	2,967,000



ポーラ・オルビスホールディングス	62,200	2,878.00	179,011,600	
ノビアホールディングス	12,500	5,660.00	70,750,000	
アジュバンコスメジャパン	3,500	1,036.00	3,626,000	
新日本製薬	2,800	2,085.00	5,838,000	
エステー	9,500	1,721.00	16,349,500	
アグロ カネショウ	5,500	1,409.00	7,749,500	
コニシ	24,000	1,615.00	38,760,000	
長谷川香料	25,300	2,514.00	63,604,200	
星光PMC	8,500	935.00	7,947,500	
小林製薬	40,900	9,390.00	384,051,000	
荒川化学工業	12,200	1,190.00	14,518,000	
メック	10,000	3,320.00	33,200,000	
日本高純度化学	3,900	2,901.00	11,313,900	
タカラバイオ	38,100	2,913.00	110,985,300	
JCU	16,600	3,725.00	61,835,000	
新田ゼラチン	9,400	635.00	5,969,000	
OATアグリオ	2,800	1,401.00	3,922,800	
デクセリアルズ	40,600	2,379.00	96,587,400	
アース製薬	11,000	6,470.00	71,170,000	
北興化学工業	13,600	1,075.00	14,620,000	
大成ラミック	4,700	2,748.00	12,915,600	
クミアイ化学工業	60,200	854.00	51,410,800	
日本農薬	26,100	513.00	13,389,300	
富士興産	4,400	1,089.00	4,791,600	
ニチレキ	17,500	1,351.00	23,642,500	
ユシロ化学工業	8,300	1,195.00	9,918,500	
ビーピー・カストロール	5,200	1,343.00	6,983,600	
富士石油	35,500	261.00	9,265,500	
MORESCO	5,500	1,091.00	6,000,500	
出光興産	161,800	2,622.00	424,239,600	
ENEOSホールディングス	2,194,600	470.50	1,032,559,300	
コスモエネルギーホールディングス	46,200	2,542.00	117,440,400	
テスホールディングス	8,500	2,084.00	17,714,000	
横浜ゴム	84,500	2,285.00	193,082,500	
TOYO TIRE	76,500	2,225.00	170,212,500	
ブリヂストン	388,000	4,960.00	1,924,480,000	
住友ゴム工業	131,000	1,500.00	196,500,000	
藤倉コンポジット	13,200	488.00	6,441,600	
オカモト	9,100	4,165.00	37,901,500	
アキレス	10,300	1,388.00	14,296,400	
フコク	5,500	930.00	5,115,000	
ニッタ	15,200	2,700.00	41,040,000	
クリエートメディック	5,000	985.00	4,925,000	
住友理工	28,300	724.00	20,489,200	
三ツ星ベルト	17,700	1,827.00	32,337,900	
パンドー化学	25,800	919.00	23,710,200	
AGC	134,000	4,665.00	625,110,000	
日本板硝子	74,600	606.00	45,207,600	
石塚硝子	2,700	1,877.00	5,067,900	
有沢製作所	20,300	891.00	18,087,300	

日本山村硝子	6,400	920.00	5,888,000
日本電気硝子	54,000	2,509.00	135,486,000
オハラ	6,000	1,444.00	8,664,000
住友大阪セメント	26,300	3,000.00	78,900,000
太平洋セメント	83,400	2,487.00	207,415,800
リソールホールディングス	1,000	3,985.00	3,985,000
日本ヒューム	13,800	733.00	10,115,400
日本コンクリート工業	30,900	318.00	9,826,200
三谷セキサン	6,700	4,345.00	29,111,500
アジアパイルホールディングス	22,700	455.00	10,328,500
東海カーボン	142,400	1,498.00	213,315,200
日本カーボン	8,200	4,095.00	33,579,000
東洋炭素	8,600	2,781.00	23,916,600
ノリタケカンパニーリミテド	8,300	4,295.00	35,648,500
TOTO	104,200	5,790.00	603,318,000
日本碍子	160,100	1,848.00	295,864,800
日本特殊陶業	110,800	1,618.00	179,274,400
ダントーホールディングス	9,200	330.00	3,036,000
MARUWA	4,800	11,050.00	53,040,000
品川リフラクトリーズ	3,300	3,965.00	13,084,500
黒崎播磨	2,600	4,795.00	12,467,000
ヨータイ	10,500	1,330.00	13,965,000
イソライト工業	6,500	682.00	4,433,000
東京窯業	19,200	319.00	6,124,800
ニッカトー	6,700	687.00	4,602,900
フジインコーポレーテッド	12,000	4,845.00	58,140,000
クニミネ工業	4,600	1,184.00	5,446,400
エーアンドエーマテリアル	2,800	1,013.00	2,836,400
ニチアス	36,900	2,816.00	103,910,400
日本製鉄	688,200	1,828.50	1,258,373,700
神戸製鋼所	264,100	704.00	185,926,400
中山製鋼所	20,800	396.00	8,236,800
合同製鐵	7,700	1,634.00	12,581,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	417,400	1,292.00	539,280,800
東京製鐵	56,500	1,070.00	60,455,000
共英製鋼	16,100	1,402.00	22,572,200
大和工業	30,500	3,600.00	109,800,000
東京鐵鋼	5,600	1,581.00	8,853,600
大阪製鐵	7,600	1,114.00	8,466,400
淀川製鋼所	19,600	2,332.00	45,707,200
丸一鋼管	46,800	2,660.00	124,488,000
モリ工業	4,300	2,328.00	10,010,400
大同特殊鋼	23,500	5,330.00	125,255,000
日本高周波鋼業	4,800	385.00	1,848,000
日本冶金工業	11,200	2,280.00	25,536,000
山陽特殊製鋼	17,500	1,577.00	27,597,500
愛知製鋼	8,300	3,060.00	25,398,000
日立金属	136,100	2,130.00	289,893,000
日本金属	3,500	952.00	3,332,000

大平洋金属	9,700	1,681.00	16,305,700
新日本電工	93,300	300.00	27,990,000
栗本鐵工所	6,700	1,690.00	11,323,000
虹 技	1,500	1,111.00	1,666,500
日本鑄鉄管	1,700	1,244.00	2,114,800
日本製鋼所	43,700	2,809.00	122,753,300
三菱製鋼	10,800	1,097.00	11,847,600
日亜鋼業	21,800	291.00	6,343,800
日本精線	2,000	4,530.00	9,060,000
エンビプロ・ホールディングス	6,300	1,240.00	7,812,000
大紀アルミニウム工業所	21,600	1,146.00	24,753,600
日本軽金属ホールディングス	39,300	1,877.00	73,766,100
三井金属鉱業	38,800	3,050.00	118,340,000
東邦亜鉛	8,200	1,875.00	15,375,000
三菱マテリアル	95,100	2,246.00	213,594,600
住友金属鉱山	184,300	4,405.00	811,841,500
DOWAホールディングス	36,200	4,280.00	154,936,000
古河機械金属	23,800	1,257.00	29,916,600
エス・サイエンス	58,400	38.00	2,219,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,300	780.00	11,934,000
東邦チタニウム	26,000	1,021.00	26,546,000
UACJ	21,800	2,872.00	62,609,600
CKサンエツ	2,800	3,035.00	8,498,000
古河電気工業	45,100	2,766.00	124,746,600
住友電気工業	503,100	1,595.50	802,696,050
フジクラ	174,500	560.00	97,720,000
昭和電線ホールディングス	14,100	1,824.00	25,718,400
東京特殊電線	1,800	2,597.00	4,674,600
タツタ電線	25,200	557.00	14,036,400
カナレ電気	2,800	1,677.00	4,695,600
平河ヒューテック	7,900	1,205.00	9,519,500
リョービ	17,500	1,521.00	26,617,500
アーレスティ	18,000	485.00	8,730,000
アサヒホールディングス	54,000	2,265.00	122,310,000
東洋製罐グループホールディングス	91,700	1,427.00	130,855,900
ホッカンホールディングス	7,300	1,413.00	10,314,900
コロナ	8,200	930.00	7,626,000
横河ブリッジホールディングス	24,800	2,079.00	51,559,200
駒井ハルテック	2,800	1,699.00	4,757,200
高田機工	1,000	2,734.00	2,734,000
三和ホールディングス	136,100	1,348.00	183,462,800
文化シャッター	42,700	1,171.00	50,001,700
三協立山	18,500	865.00	16,002,500
アルインコ	9,500	1,023.00	9,718,500
東洋シャッター	2,900	639.00	1,853,100
LIXIL	198,600	2,954.00	586,664,400
日本フィルコン	10,400	519.00	5,397,600
ノーリツ	29,800	1,859.00	55,398,200
長府製作所	14,800	2,048.00	30,310,400
リンナイ	28,000	10,530.00	294,840,000

ユニプレス	24,200	967.00	23,401,400
ダイニチ工業	6,700	758.00	5,078,600
日東精工	18,600	595.00	11,067,000
三洋工業	1,500	1,897.00	2,845,500
岡部	29,800	658.00	19,608,400
ジーテクト	18,000	1,544.00	27,792,000
東プレ	27,000	1,566.00	42,282,000
高周波熱錬	27,400	577.00	15,809,800
東京製綱	10,500	1,117.00	11,728,500
サンコール	12,700	455.00	5,778,500
モリテックスチール	11,000	476.00	5,236,000
パイオラックス	21,300	1,515.00	32,269,500
エイチワン	14,300	747.00	10,682,100
日本発条	143,600	863.00	123,926,800
中央発條	5,000	1,406.00	7,030,000
アドバネクス	1,900	1,283.00	2,437,700
三浦工業	62,400	4,965.00	309,816,000
タクマ	48,900	1,714.00	83,814,600
テクノプロ・ホールディングス	84,000	2,735.00	229,740,000
アトラグループ	3,000	331.00	993,000
インターワークス	4,300	415.00	1,784,500
アイ・アールジャパンホールディングス	5,800	14,460.00	83,868,000
Keeper 技研	9,000	3,005.00	27,045,000
ファーストロジック	2,800	790.00	2,212,000
三機サービス	2,800	1,077.00	3,015,600
Gunosy	8,500	921.00	7,828,500
デザインワン・ジャパン	4,400	245.00	1,078,000
イー・ガーディアン	6,100	2,814.00	17,165,400
リブセンス	7,500	220.00	1,650,000
ジャパンマテリアル	43,100	1,352.00	58,271,200
ベクトル	17,700	945.00	16,726,500
ウチヤマホールディングス	7,000	372.00	2,604,000
チャーム・ケア・コーポレーション	10,300	1,196.00	12,318,800
キャリアリンク	4,500	2,093.00	9,418,500
IBJ	11,600	1,155.00	13,398,000
アサンテ	5,000	1,764.00	8,820,000
バリューHR	5,600	1,677.00	9,391,200
M&Aキャピタルパートナーズ	11,600	5,660.00	65,656,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,200	1,397.00	7,264,400
ERIホールディングス	3,400	654.00	2,223,600
アビスト	2,200	2,988.00	6,573,600
シグマクシス	7,500	2,359.00	17,692,500
ウィルグループ	10,300	1,010.00	10,403,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	20,300	250.00	5,075,000
メドピア	10,700	4,445.00	47,561,500
レアジョブ	1,900	1,700.00	3,230,000
リクルートホールディングス	998,600	5,709.00	5,701,007,400
エラン	19,300	1,273.00	24,568,900

ツガミ	29,800	1,658.00	49,408,400
オークマ	16,800	5,480.00	92,064,000
芝浦機械	15,200	2,569.00	39,048,800
アマダ	211,100	1,141.00	240,865,100
アイダエンジニアリング	37,800	966.00	36,514,800
滝澤鉄工所	4,700	1,123.00	5,278,100
F U J I	57,700	2,577.00	148,692,900
牧野フライス製作所	16,900	4,400.00	74,360,000
オーエスジー	71,300	2,067.00	147,377,100
ダイジェット工業	1,100	1,313.00	1,444,300
旭ダイヤモンド工業	38,400	523.00	20,083,200
D M G 森精機	91,200	1,848.00	168,537,600
ソディック	31,600	1,032.00	32,611,200
ディスコ	19,600	33,250.00	651,700,000
日東工器	6,800	1,878.00	12,770,400
日進工具	11,300	1,468.00	16,588,400
パンチ工業	12,200	630.00	7,686,000
富士ダイス	7,800	669.00	5,218,200
土木管理総合試験所	6,700	399.00	2,673,300
ネットマーケティング	6,800	401.00	2,726,800
日本郵政	1,055,100	921.50	972,274,650
ベルシステム24ホールディングス	23,400	1,792.00	41,932,800
鎌倉新書	14,100	1,007.00	14,198,700
S M N	2,900	797.00	2,311,300
一蔵	2,000	413.00	826,000
グローバルキッズCOMPANY	2,700	986.00	2,662,200
エアトリ	8,900	2,783.00	24,768,700
アトラエ	8,500	2,311.00	19,643,500
ストライク	5,000	3,780.00	18,900,000
ソラスト	34,300	1,411.00	48,397,300
セラク	4,300	2,176.00	9,356,800
インソース	13,400	2,557.00	34,263,800
豊田自動織機	118,200	9,420.00	1,113,444,000
豊和工業	7,900	820.00	6,478,000
O K K	5,900	440.00	2,596,000
石川製作所	3,100	1,544.00	4,786,400
東洋機械金属	10,300	509.00	5,242,700
津田駒工業	2,800	881.00	2,466,800
エンシュウ	2,900	862.00	2,499,800
島精機製作所	21,400	1,915.00	40,981,000
オプトラン	18,200	2,412.00	43,898,400
N C ホールディングス	3,700	1,235.00	4,569,500
イワキ	9,400	913.00	8,582,200
フリーー	14,200	1,376.00	19,539,200
ヤマシンフィルタ	29,100	727.00	21,155,700
日阪製作所	18,300	832.00	15,225,600
やまびこ	28,000	1,238.00	34,664,000
平田機工	6,700	6,510.00	43,617,000
ペガサスミシン製造	15,600	478.00	7,456,800
マルマエ	5,200	2,142.00	11,138,400

タツモ	6,100	1,727.00	10,534,700
ナブテスコ	85,000	4,215.00	358,275,000
三井海洋開発	15,700	1,978.00	31,054,600
レオン自動機	14,100	1,387.00	19,556,700
S M C	42,600	67,860.00	2,890,836,000
ホソカワミクロン	4,800	6,190.00	29,712,000
ユニオンツール	5,300	4,080.00	21,624,000
オイレス工業	20,200	1,607.00	32,461,400
日精エー・エス・ピー機械	4,700	4,830.00	22,701,000
サトーホールディングス	19,000	2,725.00	51,775,000
技研製作所	12,800	4,860.00	62,208,000
日本エアーテック	4,700	1,260.00	5,922,000
カワタ	3,900	882.00	3,439,800
日精樹脂工業	11,200	1,374.00	15,388,800
オカダアイヨン	4,600	1,339.00	6,159,400
ワイエイシイホールディングス	5,800	1,105.00	6,409,000
小松製作所	661,000	2,731.50	1,805,521,500
住友重機械工業	83,600	3,115.00	260,414,000
日立建機	68,300	3,305.00	225,731,500
日工	21,900	692.00	15,154,800
巴工業	5,900	2,290.00	13,511,000
井関農機	14,600	1,480.00	21,608,000
T O W A	13,900	2,258.00	31,386,200
丸山製作所	2,900	1,774.00	5,144,600
北川鉄工所	6,700	1,672.00	11,202,400
シンニッタン	17,700	250.00	4,425,000
ローツェ	6,500	9,600.00	62,400,000
タカキタ	5,200	612.00	3,182,400
クボタ	766,300	2,272.50	1,741,416,750
荏原実業	6,800	2,843.00	19,332,400
東洋エンジニアリング	16,300	722.00	11,768,600
三菱化工機	4,700	2,532.00	11,900,400
月島機械	26,800	1,194.00	31,999,200
帝国電機製作所	10,300	1,245.00	12,823,500
東京機械製作所	5,500	830.00	4,565,000
新東工業	34,700	803.00	27,864,100
澁谷工業	12,800	3,180.00	40,704,000
アイチコーポレーション	25,400	855.00	21,717,000
小森コーポレーション	37,100	824.00	30,570,400
鶴見製作所	11,200	1,715.00	19,208,000
住友精密工業	2,500	2,910.00	7,275,000
日本ギア工業	7,100	322.00	2,286,200
酒井重工業	2,500	2,653.00	6,632,500
荏原製作所	60,400	5,450.00	329,180,000
石井鐵工所	1,400	3,050.00	4,270,000
西島製作所	15,100	875.00	13,212,500
北越工業	15,300	1,085.00	16,600,500
ダイキン工業	185,700	22,025.00	4,090,042,500
オルガノ	4,700	6,100.00	28,670,000
トーヨーカネツ	5,400	2,435.00	13,149,000

栗田工業	79,000	5,550.00	438,450,000
椿本チエイン	20,600	3,270.00	67,362,000
大同工業	5,900	1,123.00	6,625,700
日機装	47,100	1,145.00	53,929,500
木村化工機	12,200	863.00	10,528,600
レイズネクスト	24,700	1,181.00	29,170,700
アネスト岩田	24,700	1,050.00	25,935,000
ダイフク	80,400	10,000.00	804,000,000
サムコ	3,400	3,240.00	11,016,000
加藤製作所	7,800	993.00	7,745,400
油研工業	2,100	1,756.00	3,687,600
タダノ	70,400	1,151.00	81,030,400
フジテック	50,400	2,474.00	124,689,600
C K D	33,600	2,306.00	77,481,600
キトー	12,400	1,682.00	20,856,800
平和	40,500	2,018.00	81,729,000
理想科学工業	11,200	1,759.00	19,700,800
S A N K Y O	34,400	2,878.00	99,003,200
日本金銭機械	16,200	618.00	10,011,600
マースグループホールディングス	9,400	1,624.00	15,265,600
フクシマガリレイ	10,100	4,485.00	45,298,500
オーイズミ	6,300	386.00	2,431,800
ダイコク電機	6,700	921.00	6,170,700
竹内製作所	24,300	2,904.00	70,567,200
アマノ	38,100	2,866.00	109,194,600
J U K I	20,700	797.00	16,497,900
サンデンホールディングス	17,600	333.00	5,860,800
蛇の目マシン工業	13,100	753.00	9,864,300
ブラザー工業	178,000	2,246.00	399,788,000
マックス	20,200	1,837.00	37,107,400
モリタホールディングス	23,400	1,624.00	38,001,600
グローリー	37,400	2,374.00	88,787,600
新晃工業	13,800	1,934.00	26,689,200
大和冷機工業	23,200	1,066.00	24,731,200
セガサミーホールディングス	132,700	1,494.00	198,253,800
日本ピストンリング	5,500	1,284.00	7,062,000
リケン	6,700	2,603.00	17,440,100
T P R	19,700	1,499.00	29,530,300
ツバキ・ナカシマ	28,200	1,698.00	47,883,600
ホシザキ	45,900	9,420.00	432,378,000
大豊工業	12,200	941.00	11,480,200
日本精工	299,500	917.00	274,641,500
N T N	336,800	292.00	98,345,600
ジェイテクト	139,800	1,147.00	160,350,600
不二越	13,900	4,320.00	60,048,000
ミネベアミツミ	251,300	3,125.00	785,312,500
日本トムソン	39,900	662.00	26,413,800
T H K	90,900	3,425.00	311,332,500
ユーシン精機	9,700	829.00	8,041,300
前澤給装工業	10,200	1,063.00	10,842,600

イーグル工業	18,300	1,124.00	20,569,200
前澤工業	8,800	692.00	6,089,600
日本ピラー工業	15,000	2,293.00	34,395,000
キッツ	45,600	774.00	35,294,400
日立製作所	701,000	6,729.00	4,717,029,000
東芝	288,700	4,935.00	1,424,734,500
三菱電機	1,459,100	1,484.50	2,166,033,950
富士電機	87,800	5,230.00	459,194,000
東洋電機製造	5,900	1,157.00	6,826,300
安川電機	157,000	5,760.00	904,320,000
シンフォニアテクノロジー	19,200	1,282.00	24,614,400
明電舎	24,800	2,241.00	55,576,800
オリジン	3,100	1,344.00	4,166,400
山洋電気	6,800	7,760.00	52,768,000
デンヨー	12,600	2,005.00	25,263,000
ベイカレント・コンサルティング	9,100	35,750.00	325,325,000
Orchestra Holdings	2,900	2,995.00	8,685,500
アイモバイル	4,800	1,573.00	7,550,400
キャリアインデックス	5,800	935.00	5,423,000
MS - Japan	5,700	1,227.00	6,993,900
船場	2,000	833.00	1,666,000
グレイステクノロジー	13,800	1,574.00	21,721,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	40,200	2,561.00	102,952,200
フルテック	2,100	1,369.00	2,874,900
グリーンズ	4,300	614.00	2,640,200
ツナググループ・ホールディングス	1,800	342.00	615,600
GAMewith	4,300	589.00	2,532,700
ソウルドアウト	3,000	1,773.00	5,319,000
MS&Consulting	2,500	601.00	1,502,500
ウェルビー	4,400	1,362.00	5,992,800
エル・ティー・エス	900	4,080.00	3,672,000
ミダック	5,800	4,340.00	25,172,000
日総工産	11,000	834.00	9,174,000
キュービーネットホールディングス	6,700	1,672.00	11,202,400
RPAホールディングス	15,800	779.00	12,308,200
三櫻工業	20,200	1,186.00	23,957,200
マキタ	190,300	5,500.00	1,046,650,000
東芝テック	15,900	4,650.00	73,935,000
芝浦メカトロニクス	2,800	7,880.00	22,064,000
マブチモーター	40,300	4,225.00	170,267,500
日本電産	351,300	13,115.00	4,607,299,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,500	787.00	5,902,500
トレックス・セミコンダクター	8,200	3,000.00	24,600,000
東光高岳	7,300	1,353.00	9,876,900
ダブル・スコープ	24,700	650.00	16,055,000
宮越ホールディングス	4,600	1,119.00	5,147,400
ダイヘン	16,000	4,800.00	76,800,000
ヤーマン	23,700	1,350.00	31,995,000



JVCケンウッド	126,000	235.00	29,610,000
ミマキエンジニアリング	14,000	788.00	11,032,000
I-PEX	6,800	2,384.00	16,211,200
日新電機	34,700	1,364.00	47,330,800
大崎電気工業	29,000	629.00	18,241,000
オムロン	121,500	9,370.00	1,138,455,000
日東工業	21,300	1,882.00	40,086,600
I D E C	19,800	2,253.00	44,609,400
正興電機製作所	4,400	1,741.00	7,660,400
不二電機工業	2,800	1,290.00	3,612,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	52,300	2,803.00	146,596,900
サクサホールディングス	3,300	1,338.00	4,415,400
メルコホールディングス	4,800	5,650.00	27,120,000
テクノメディカ	3,300	1,611.00	5,316,300
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,700	2,794.00	10,337,800
日本電気	185,300	5,660.00	1,048,798,000
富士通	131,400	21,165.00	2,781,081,000
沖電気工業	59,300	1,024.00	60,723,200
岩崎通信機	5,500	942.00	5,181,000
電気興業	6,800	2,253.00	15,320,400
サンケン電気	17,100	5,490.00	93,879,000
ナカヨ	2,500	1,430.00	3,575,000
アイホン	8,300	2,041.00	16,940,300
ルネサスエレクトロニクス	698,500	1,213.00	847,280,500
セイコーエプソン	180,600	1,957.00	353,434,200
ワコム	105,500	710.00	74,905,000
アルバック	26,700	5,600.00	149,520,000
アクセル	6,300	882.00	5,556,600
E I Z O	12,500	4,935.00	61,687,500
ジャパンディスプレイ	430,800	35.00	15,078,000
日本信号	34,500	926.00	31,947,000
京三製作所	31,600	424.00	13,398,400
能美防災	19,400	2,126.00	41,244,400
ホーチキ	10,700	1,178.00	12,604,600
星和電機	7,200	515.00	3,708,000
エレコム	33,600	2,086.00	70,089,600
パナソニック	1,555,900	1,327.50	2,065,457,250
シャープ	194,000	1,785.00	346,290,000
アンリツ	87,700	2,048.00	179,609,600
富士通ゼネラル	44,800	2,924.00	130,995,200
ソニーグループ	913,800	11,485.00	10,494,993,000
T D K	70,500	13,500.00	951,750,000
帝国通信工業	6,700	1,123.00	7,524,100
タムラ製作所	53,300	956.00	50,954,800
アルプスアルパイン	119,100	1,151.00	137,084,100
池上通信機	4,800	835.00	4,008,000
日本電波工業	12,300	905.00	11,131,500
鈴木	6,500	950.00	6,175,000
日本トリム	2,900	3,800.00	11,020,000

ローランド ディー・ジー	8,800	2,708.00	23,830,400	
フォスター電機	15,600	949.00	14,804,400	
SMK	3,600	2,450.00	8,820,000	
ヨコオ	10,900	2,554.00	27,838,600	
ティアック	7,700	124.00	954,800	
ホシデン	39,600	1,025.00	40,590,000	
ヒロセ電機	22,500	16,580.00	373,050,000	
日本航空電子工業	33,600	1,844.00	61,958,400	
TOA	17,300	857.00	14,826,100	
マクセルホールディングス	29,100	1,282.00	37,306,200	
古野電気	18,600	1,031.00	19,176,600	
ユニデンホールディングス	3,500	2,592.00	9,072,000	
スミダコーポレーション	12,400	1,224.00	15,177,600	
アイコム	6,200	2,404.00	14,904,800	
リオン	6,200	2,762.00	17,124,400	
本多通信工業	12,000	486.00	5,832,000	
横河電機	145,900	1,668.00	243,361,200	
新電元工業	5,800	4,490.00	26,042,000	
アズビル	98,600	4,580.00	451,588,000	
東亜ディーケーケー	7,500	813.00	6,097,500	
日本光電工業	60,200	3,335.00	200,767,000	
チノー	4,600	1,492.00	6,863,200	
共和電業	16,400	385.00	6,314,000	
日本電子材料	5,300	1,796.00	9,518,800	
堀場製作所	28,800	7,170.00	206,496,000	
アドバンテスト	108,300	9,680.00	1,048,344,000	
小野測器	5,300	581.00	3,079,300	
エスベック	13,000	2,236.00	29,068,000	
キーエンス	143,200	58,470.00	8,372,904,000	
日置電機	6,700	7,120.00	47,704,000	
シスメックス	113,800	13,100.00	1,490,780,000	
日本マイクロニクス	25,600	1,444.00	36,966,400	
メガチップス	14,800	3,325.00	49,210,000	
OBARA GROUP	6,900	3,930.00	27,117,000	
IMAGICA GROUP	12,800	439.00	5,619,200	
澤藤電機	1,500	2,146.00	3,219,000	
デンソー	321,200	7,519.00	2,415,102,800	
原田工業	6,200	911.00	5,648,200	
コーセル	17,800	1,024.00	18,227,200	
イリソ電子工業	12,400	5,320.00	65,968,000	
オブテックスグループ	24,300	1,810.00	43,983,000	
千代田インテグレ	6,500	1,771.00	11,511,500	
アイ・オー・データ機器	5,300	1,010.00	5,353,000	
レーザーテック	63,900	22,230.00	1,420,497,000	
スタンレー電気	102,200	3,120.00	318,864,000	
岩崎電気	5,300	1,993.00	10,562,900	
ウシオ電機	74,800	2,087.00	156,107,600	
岡谷電機産業	10,700	375.00	4,012,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	14,400	341.00	4,910,400	
エノモト	4,000	1,732.00	6,928,000	

日本セラミック	14,900	2,919.00	43,493,100
遠藤照明	8,200	729.00	5,977,800
古河電池	10,500	1,508.00	15,834,000
双信電機	7,400	543.00	4,018,200
山一電機	9,500	1,630.00	15,485,000
図研	9,500	3,405.00	32,347,500
日本電子	26,600	6,630.00	176,358,000
カシオ計算機	117,400	1,898.00	222,825,200
ファナック	128,100	27,535.00	3,527,233,500
日本シイエムケイ	32,000	422.00	13,504,000
エンプラス	6,700	3,495.00	23,416,500
大真空	4,800	3,740.00	17,952,000
ローム	60,700	10,220.00	620,354,000
浜松ホトニクス	104,500	6,660.00	695,970,000
三井ハイテック	14,400	6,160.00	88,704,000
新光電気工業	48,900	3,990.00	195,111,000
京セラ	222,300	6,833.00	1,518,975,900
協栄産業	1,800	1,435.00	2,583,000
太陽誘電	64,700	5,500.00	355,850,000
村田製作所	428,900	9,113.00	3,908,565,700
双葉電子工業	25,400	791.00	20,091,400
日東電工	88,100	8,290.00	730,349,000
北陸電気工業	5,800	1,030.00	5,974,000
東海理化電機製作所	38,300	1,754.00	67,178,200
ニチコン	46,000	1,182.00	54,372,000
日本ケミコン	15,000	2,636.00	39,540,000
K O A	20,300	1,635.00	33,190,500
三井E & Sホールディングス	48,600	530.00	25,758,000
日立造船	115,600	792.00	91,555,200
三菱重工業	228,900	3,236.00	740,720,400
川崎重工業	113,400	2,391.00	271,139,400
I H I	98,000	2,551.00	249,998,000
名村造船所	45,600	187.00	8,527,200
サノヤホールディングス	19,000	158.00	3,002,000
スプリックス	3,900	1,200.00	4,680,000
マネジメントソリューションズ	6,700	2,889.00	19,356,300
プロレド・パートナーズ	1,900	2,797.00	5,314,300
and factory	1,100	649.00	713,900
テノ・ホールディングス	1,000	1,184.00	1,184,000
フロンティア・マネジメント	2,600	1,140.00	2,964,000
ピアラ	900	1,043.00	938,700
コプロ・ホールディングス	1,800	1,376.00	2,476,800
ギークス	1,900	1,888.00	3,587,200
カーブスホールディングス	38,300	982.00	37,610,600
フォーラムエンジニアリング	9,300	935.00	8,695,500
日本車輛製造	5,200	2,107.00	10,956,400
三菱ロジスネクスト	19,400	1,023.00	19,846,200
近畿車輛	2,000	1,188.00	2,376,000
F P G	48,600	746.00	36,255,600
島根銀行	5,200	617.00	3,208,400

じもとホールディングス	9,900	642.00	6,355,800	
全国保証	37,300	4,930.00	183,889,000	
めぶきフィナンシャルグループ	745,900	237.00	176,778,300	
ジャパンインベストメントアドバイザ	9,500	1,506.00	14,307,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,000	1,524.00	27,432,000	
九州フィナンシャルグループ	294,100	394.00	115,875,400	
かんぼ生命保険	178,200	1,980.00	352,836,000	
ゆうちょ銀行	407,800	928.00	378,438,400	
富山第一銀行	35,100	278.00	9,757,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	875,600	401.00	351,115,600	
ジェイリース	4,100	1,265.00	5,186,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	95,700	628.00	60,099,600	
イントラスト	3,900	677.00	2,640,300	
日本モーゲージサービス	7,200	1,012.00	7,286,400	
CASA	3,900	989.00	3,857,100	
アルヒ	21,300	1,425.00	30,352,500	
プレミアグループ	6,700	3,465.00	23,215,500	
日産自動車	1,720,300	586.00	1,008,095,800	
いすゞ自動車	387,200	1,494.00	578,476,800	
トヨタ自動車	1,478,100	9,815.00	14,507,551,500	
日野自動車	182,100	967.00	176,090,700	
三菱自動車工業	539,500	309.00	166,705,500	
エフテック	10,500	839.00	8,809,500	
レシップホールディングス	5,800	569.00	3,300,200	
GMB	2,900	1,238.00	3,590,200	
ファルテック	2,900	727.00	2,108,300	
武蔵精密工業	32,500	2,366.00	76,895,000	
日産車体	21,300	733.00	15,612,900	
新明和工業	41,300	961.00	39,689,300	
極東開発工業	25,200	1,571.00	39,589,200	
トビー工業	12,700	1,282.00	16,281,400	
ティラド	4,800	2,668.00	12,806,400	
曙ブレーキ工業	68,400	172.00	11,764,800	
タチエス	22,500	1,395.00	31,387,500	
NOK	70,600	1,356.00	95,733,600	
フタバ産業	36,400	531.00	19,328,400	
KYB	16,600	3,745.00	62,167,000	
市光工業	22,100	693.00	15,315,300	
大同メタル工業	30,100	597.00	17,969,700	
プレス工業	73,500	358.00	26,313,000	
ミクニ	19,600	310.00	6,076,000	
太平洋工業	30,600	1,192.00	36,475,200	
河西工業	20,600	397.00	8,178,200	
アイシン	106,700	4,735.00	505,224,500	
マツダ	457,400	1,061.00	485,301,400	
今仙電機製作所	12,700	702.00	8,915,400	
本田技研工業	1,148,600	3,565.00	4,094,759,000	

スズキ	289,400	4,730.00	1,368,862,000	
S U B A R U	418,100	2,149.00	898,496,900	
安永	6,900	1,155.00	7,969,500	
ヤマハ発動機	206,200	2,837.00	584,989,400	
小糸製作所	87,500	6,580.00	575,750,000	
T B K	15,100	414.00	6,251,400	
エクセディ	20,100	1,638.00	32,923,800	
ミツバ	23,100	794.00	18,341,400	
豊田合成	47,100	2,645.00	124,579,500	
愛三工業	24,100	874.00	21,063,400	
盟和産業	2,000	1,002.00	2,004,000	
日本プラスト	13,000	705.00	9,165,000	
ヨロズ	12,900	1,206.00	15,557,400	
エフ・シー・シー	23,800	1,569.00	37,342,200	
新家工業	3,600	1,587.00	5,713,200	
シマノ	54,700	28,460.00	1,556,762,000	
テイ・エス テック	67,800	1,652.00	112,005,600	
三十三フィナンシャルグループ	12,700	1,382.00	17,551,400	
第四北越フィナンシャルグループ	23,400	2,429.00	56,838,600	
ひろぎんホールディングス	212,800	588.00	125,126,400	
マーキュリアホールディングス	5,200	737.00	3,832,400	
ダイレクトマーケティングミックス	7,000	3,930.00	27,510,000	
ポピンズホールディングス	3,500	4,640.00	16,240,000	
L I T A L I C O	5,800	5,440.00	31,552,000	
ジャムコ	9,100	1,101.00	10,019,100	
小野建	13,000	1,305.00	16,965,000	
はるやまホールディングス	7,400	641.00	4,743,400	
南陽	2,700	2,006.00	5,416,200	
ノジマ	25,400	2,782.00	70,662,800	
佐鳥電機	9,400	818.00	7,689,200	
カッパ・クリエイト	20,200	1,460.00	29,492,000	
エコートレーディング	3,000	661.00	1,983,000	
伯東	8,700	1,523.00	13,250,100	
コンドーテック	11,200	1,011.00	11,323,200	
中山福	8,700	435.00	3,784,500	
ライトオン	10,800	723.00	7,808,400	
ナガイレーベン	19,300	2,572.00	49,639,600	
三菱食品	16,000	2,826.00	45,216,000	
良品計画	165,300	2,093.00	345,972,900	
三城ホールディングス	18,300	269.00	4,922,700	
松田産業	10,400	2,201.00	22,890,400	
第一興商	27,300	4,350.00	118,755,000	
メディバルホールディングス	143,800	2,163.00	311,039,400	
アドヴァングループ	14,800	924.00	13,675,200	
S P K	6,600	1,377.00	9,088,200	
萩原電気ホールディングス	5,300	2,267.00	12,015,100	
アルビス	4,600	2,324.00	10,690,400	
アズワン	10,300	15,050.00	155,015,000	
スズデン	4,400	1,472.00	6,476,800	
尾家産業	3,600	1,235.00	4,446,000	

シモジマ	8,000	1,079.00	8,632,000
ドウシシャ	13,900	1,722.00	23,935,800
小津産業	2,900	1,950.00	5,655,000
コナカ	17,700	350.00	6,195,000
高速	7,600	1,468.00	11,156,800
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,653.00	2,314,200
G-7ホールディングス	7,000	3,455.00	24,185,000
たけびし	4,400	1,559.00	6,859,600
イオン北海道	19,400	1,053.00	20,428,200
コジマ	24,500	684.00	16,758,000
ヒマラヤ	5,200	1,059.00	5,506,800
コーナン商事	20,300	3,785.00	76,835,500
ネットワンシステムズ	58,500	3,815.00	223,177,500
エコス	5,200	1,913.00	9,947,600
ワタミ	19,400	965.00	18,721,000
マルシェ	3,700	501.00	1,853,700
リックス	2,900	1,517.00	4,399,300
システムソフト	32,500	256.00	8,320,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	287,500	2,409.00	692,587,500
丸文	13,000	642.00	8,346,000
西松屋チェーン	31,600	1,399.00	44,208,400
ゼンショーホールディングス	77,100	2,820.00	217,422,000
ハビネット	12,200	1,493.00	18,214,600
幸楽苑ホールディングス	9,400	1,529.00	14,372,600
ハークスレイ	2,700	976.00	2,635,200
橋本総業ホールディングス	2,600	2,766.00	7,191,600
日本ライフライン	46,300	1,400.00	64,820,000
サイゼリヤ	21,400	2,680.00	57,352,000
タカショー	9,400	870.00	8,178,000
V Tホールディングス	54,200	459.00	24,877,800
マルカ	4,700	2,510.00	11,797,000
アルゴグラフィックス	11,200	3,545.00	39,704,000
魚力	4,300	2,092.00	8,995,600
I D O M	48,600	691.00	33,582,600
日本エム・ディ・エム	8,300	2,252.00	18,691,600
ポプラ	3,400	263.00	894,200
フジ・コーポレーション	7,400	1,266.00	9,368,400
ユナイテッドアローズ	16,700	2,121.00	35,420,700
進和	8,600	2,247.00	19,324,200
エスケイジャパン	3,000	482.00	1,446,000
ダイترون	6,200	1,980.00	12,276,000
ハイデイ日高	20,700	1,875.00	38,812,500
シークス	18,400	1,438.00	26,459,200
京都きもの友禅	8,200	261.00	2,140,200
コロワイド	47,800	2,028.00	96,938,400
ピーシーデポコーポレーション	16,700	491.00	8,199,700
田中商事	3,700	669.00	2,475,300
オーハシテクニカ	7,500	1,543.00	11,572,500
壺番屋	10,300	4,965.00	51,139,500

白銅	4,600	2,188.00	10,064,800
トップカルチャー	5,200	350.00	1,820,000
P L A N T	3,600	719.00	2,588,400
スギホールディングス	28,500	7,790.00	222,015,000
ダイコー通産	1,200	1,298.00	1,557,600
薬王堂ホールディングス	6,300	2,311.00	14,559,300
島津製作所	187,600	4,400.00	825,440,000
J M S	12,400	813.00	10,081,200
クボテック	3,200	320.00	1,024,000
長野計器	10,600	1,052.00	11,151,200
ブイ・テクノロジー	6,700	5,150.00	34,505,000
スター精密	22,600	1,698.00	38,374,800
東京計器	9,200	1,068.00	9,825,600
愛知時計電機	1,400	4,305.00	6,027,000
インターアクション	7,200	2,473.00	17,805,600
オーバル	13,100	289.00	3,785,900
東京精密	24,600	4,950.00	121,770,000
マニー	58,100	2,591.00	150,537,100
ニコン	222,600	1,096.00	243,969,600
トプコン	73,500	1,627.00	119,584,500
オリンパス	807,100	2,226.00	1,796,604,600
理研計器	13,000	2,743.00	35,659,000
S C R E E Nホールディングス	25,200	10,310.00	259,812,000
キヤノン電子	13,900	1,694.00	23,546,600
タムロン	12,000	2,457.00	29,484,000
H O Y A	284,600	15,030.00	4,277,538,000
シード	6,400	774.00	4,953,600
ノーリツ鋼機	13,100	2,554.00	33,457,400
エー・アンド・デイ	12,300	991.00	12,189,300
朝日インテック	153,400	2,835.00	434,889,000
キヤノン	724,700	2,505.00	1,815,373,500
リコー	371,200	1,226.00	455,091,200
シチズン時計	184,500	417.00	76,936,500
リズム	3,700	777.00	2,874,900
大研医器	11,900	551.00	6,556,900
メニコン	22,300	7,840.00	174,832,000
シンシア	1,400	608.00	851,200
中本パックス	3,600	1,760.00	6,336,000
スノーピーク	8,600	3,605.00	31,003,000
パラマウントベッドホールディングス	28,200	2,008.00	56,625,600
トランザクション	7,800	1,300.00	10,140,000
粧美堂	3,600	419.00	1,508,400
ニホンフラッシュ	12,500	1,258.00	15,725,000
前田工織	16,100	3,610.00	58,121,000
永大産業	20,300	299.00	6,069,700
アートネイチャー	14,300	692.00	9,895,600
バンダイナムコホールディングス	120,800	7,411.00	895,248,800
アイフイスジャパン	3,800	682.00	2,591,600
共立印刷	26,300	140.00	3,682,000
S H O E I	13,700	4,255.00	58,293,500

フランスベッドホールディングス	19,100	935.00	17,858,500	
マーベラス	22,300	767.00	17,104,100	
パイロットコーポレーション	25,900	3,835.00	99,326,500	
萩原工業	8,300	1,451.00	12,043,300	
エイベックス	25,100	1,746.00	43,824,600	
トッパン・フォームズ	26,300	1,082.00	28,456,600	
フジシールインターナショナル	29,800	2,250.00	67,050,000	
タカラトミー	65,400	957.00	62,587,800	
廣済堂	10,000	861.00	8,610,000	
エステールホールディングス	4,700	649.00	3,050,300	
レック	17,500	1,146.00	20,055,000	
タカノ	5,500	657.00	3,613,500	
三光合成	15,300	443.00	6,777,900	
プロネクス	12,700	1,044.00	13,258,800	
ホクシン	10,300	158.00	1,627,400	
ウッドワン	4,300	1,213.00	5,215,900	
大建工業	10,000	2,104.00	21,040,000	
きもと	23,000	280.00	6,440,000	
凸版印刷	221,500	1,810.00	400,915,000	
大日本印刷	172,900	2,448.00	423,259,200	
共同印刷	4,600	2,740.00	12,604,000	
N I S S H A	29,800	1,609.00	47,948,200	
光村印刷	1,000	1,642.00	1,642,000	
藤森工業	13,100	4,190.00	54,889,000	
TAKARA & COMPANY	7,200	1,819.00	13,096,800	
前澤化成工業	9,500	1,262.00	11,989,000	
未来工業	5,200	1,700.00	8,840,000	
アシックス	129,100	2,590.00	334,369,000	
ツツミ	3,500	2,390.00	8,365,000	
ウェーブロックホールディングス	4,800	697.00	3,345,600	
J S P	8,600	1,648.00	14,172,800	
ニチハ	20,200	2,900.00	58,580,000	
ローランド	11,200	5,440.00	60,928,000	
エフピコ	26,800	4,110.00	110,148,000	
小松ウオール工業	4,600	2,057.00	9,462,200	
ヤマハ	86,800	6,050.00	525,140,000	
河合楽器製作所	3,900	4,075.00	15,892,500	
クリナップ	14,000	550.00	7,700,000	
ピジョン	93,600	3,265.00	305,604,000	
天馬	10,900	2,629.00	28,656,100	
オリバー	2,900	3,780.00	10,962,000	
兼松サステック	900	1,800.00	1,620,000	
キングジム	12,700	892.00	11,328,400	
象印マホービン	39,300	1,610.00	63,273,000	
リンテック	31,400	2,407.00	75,579,800	
信越ポリマー	22,700	1,046.00	23,744,200	
東リ	37,700	241.00	9,085,700	
イトーキ	28,400	357.00	10,138,800	
任天堂	83,600	63,720.00	5,326,992,000	
三菱鉛筆	23,900	1,461.00	34,917,900	



松風	6,700	2,050.00	13,735,000
タカスタンダード	30,100	1,600.00	48,160,000
コクヨ	69,800	1,807.00	126,128,600
ナカバヤシ	14,900	600.00	8,940,000
ニフコ	53,600	3,945.00	211,452,000
立川ブラインド工業	6,500	1,332.00	8,658,000
グローブライド	6,700	4,900.00	32,830,000
オカムラ	50,300	1,516.00	76,254,800
バルカー	12,200	2,168.00	26,449,600
MUTOHホールディングス	1,400	1,600.00	2,240,000
伊藤忠商事	1,005,200	3,245.00	3,261,874,000
丸紅	1,416,800	966.20	1,368,912,160
スクロール	20,200	856.00	17,291,200
高島	2,000	1,844.00	3,688,000
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,832.00	24,732,000
三陽商会	7,600	1,061.00	8,063,600
長瀬産業	80,800	1,681.00	135,824,800
ナイガイ	4,700	343.00	1,612,100
蝶理	9,200	1,774.00	16,320,800
豊田通商	144,000	5,240.00	754,560,000
オンワードホールディングス	87,000	352.00	30,624,000
三共生興	22,000	570.00	12,540,000
兼松	57,500	1,464.00	84,180,000
美津濃	14,600	2,610.00	38,106,000
ツカモトコーポレーション	2,100	1,426.00	2,994,600
ルックホールディングス	4,800	1,440.00	6,912,000
三井物産	1,145,800	2,562.50	2,936,112,500
日本紙パルプ商事	7,500	3,680.00	27,600,000
東京エレクトロン	85,500	46,710.00	3,993,705,000
カメイ	18,600	1,185.00	22,041,000
東都水産	1,700	5,070.00	8,619,000
OUGホールディングス	2,200	2,872.00	6,318,400
スターゼン	10,200	2,168.00	22,113,600
セイコーホールディングス	20,400	2,403.00	49,021,200
山善	56,100	1,018.00	57,109,800
椿本興業	2,100	3,420.00	7,182,000
住友商事	906,900	1,495.50	1,356,268,950
日本ユニシス	49,900	3,480.00	173,652,000
内田洋行	5,800	4,950.00	28,710,000
三菱商事	874,500	3,104.00	2,714,448,000
第一実業	6,500	4,410.00	28,665,000
キャノンマーケティングジャパン	35,600	2,596.00	92,417,600
西華産業	7,500	1,653.00	12,397,500
佐藤商事	12,500	1,129.00	14,112,500
菱洋エレクトロ	10,900	2,604.00	28,383,600
東京産業	14,100	630.00	8,883,000
ユアサ商事	14,800	3,080.00	45,584,000
神鋼商事	3,000	2,391.00	7,173,000
トルク	7,200	235.00	1,692,000
阪和興業	28,600	3,120.00	89,232,000

正栄食品工業	9,400	3,915.00	36,801,000
カナデン	12,200	1,066.00	13,005,200
菱電商事	10,500	1,653.00	17,356,500
ニプロ	108,600	1,363.00	148,021,800
フルサト工業	7,600	1,966.00	14,941,600
岩谷産業	34,400	6,380.00	219,472,000
ナイス	5,800	1,992.00	11,553,600
ニチモウ	1,700	2,080.00	3,536,000
極東貿易	3,600	2,635.00	9,486,000
アステナホールディングス	18,900	608.00	11,491,200
兼松エレクトロニクス	7,900	3,695.00	29,190,500
三愛石油	35,500	1,392.00	49,416,000
稲畑産業	34,400	1,683.00	57,895,200
G S Iクレオス	6,700	963.00	6,452,100
明和産業	13,300	473.00	6,290,900
クワザワホールディングス	5,300	619.00	3,280,700
キムラタン	72,800	24.00	1,747,200
ヤマエ久野	10,400	1,196.00	12,438,400
ゴールドウイン	23,500	6,300.00	148,050,000
ユニ・チャーム	309,600	4,482.00	1,387,627,200
デザート	24,500	2,982.00	73,059,000
キング	6,000	483.00	2,898,000
ワキタ	28,300	1,022.00	28,922,600
ヤマトインターナショナル	13,000	341.00	4,433,000
東邦ホールディングス	46,100	1,892.00	87,221,200
サンゲツ	38,700	1,611.00	62,345,700
ミツウロコグループホールディングス	20,900	1,316.00	27,504,400
シナネンホールディングス	5,300	3,150.00	16,695,000
伊藤忠エネクス	32,300	993.00	32,073,900
サンリオ	40,300	2,012.00	81,083,600
サンワ テクノス	9,400	1,290.00	12,126,000
リョーサン	15,900	2,158.00	34,312,200
新光商事	19,700	781.00	15,385,700
トーヨー	6,700	1,585.00	10,619,500
三信電気	7,900	2,154.00	17,016,600
東陽テクニカ	15,300	1,115.00	17,059,500
モスフードサービス	20,200	3,170.00	64,034,000
加賀電子	13,000	2,944.00	38,272,000
三益半導体工業	11,200	2,584.00	28,940,800
都築電気	5,200	1,619.00	8,418,800
ソーダニッカ	14,300	555.00	7,936,500
立花エレテック	10,900	1,470.00	16,023,000
木曽路	18,900	2,415.00	45,643,500
S R Sホールディングス	18,300	815.00	14,914,500
千趣会	26,300	374.00	9,836,200
タカキュー	10,500	134.00	1,407,000
リテールパートナーズ	17,500	1,200.00	21,000,000
ケーヨー	26,800	851.00	22,806,800
上新電機	16,900	2,662.00	44,987,800
日本瓦斯	70,800	1,838.00	130,130,400

ロイヤルホールディングス	25,300	2,065.00	52,244,500
東天紅	1,000	1,128.00	1,128,000
いなげや	16,100	1,467.00	23,618,700
チヨダ	15,100	883.00	13,333,300
ライフコーポレーション	14,200	3,390.00	48,138,000
リンガーハット	18,000	2,339.00	42,102,000
MrMaxHD	19,500	646.00	12,597,000
テンアライド	12,600	337.00	4,246,200
AOKIホールディングス	29,000	673.00	19,517,000
オークワ	22,600	1,095.00	24,747,000
コメリ	22,100	2,616.00	57,813,600
青山商事	32,500	749.00	24,342,500
しまむら	16,800	10,120.00	170,016,000
はせがわ	6,600	276.00	1,821,600
高島屋	104,500	1,264.00	132,088,000
松屋	31,900	1,028.00	32,793,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,100	949.00	64,626,900
近鉄百貨店	5,600	3,165.00	17,724,000
丸井グループ	121,600	2,090.00	254,144,000
クレディセゾン	84,000	1,347.00	113,148,000
アクシアル リテイリング	12,200	3,825.00	46,665,000
井筒屋	6,700	232.00	1,554,400
イオン	552,900	2,929.00	1,619,444,100
イズミ	29,100	4,095.00	119,164,500
フォーバル	5,200	959.00	4,986,800
平和堂	26,600	2,052.00	54,583,200
フジ	17,500	1,946.00	34,055,000
ヤオコー	16,300	6,230.00	101,549,000
ゼビオホールディングス	17,400	1,005.00	17,487,000
ケーズホールディングス	123,000	1,243.00	152,889,000
PALTAC	23,000	5,350.00	123,050,000
三谷産業	19,300	385.00	7,430,500
Olympicグループ	7,300	760.00	5,548,000
日産東京販売ホールディングス	17,800	242.00	4,307,600
新生銀行	117,400	1,466.00	172,108,400
あおぞら銀行	85,800	2,485.00	213,213,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,842,600	593.10	5,837,646,060
りそなホールディングス	1,659,500	420.80	698,317,600
三井住友トラスト・ホールディングス	272,200	3,558.00	968,487,600
三井住友フィナンシャルグループ	995,900	3,769.00	3,753,547,100
千葉銀行	479,900	652.00	312,894,800
群馬銀行	296,200	349.00	103,373,800
武蔵野銀行	21,400	1,695.00	36,273,000
千葉興業銀行	37,100	257.00	9,534,700
筑波銀行	59,300	172.00	10,199,600
七十七銀行	45,400	1,171.00	53,163,400
青森銀行	11,200	2,113.00	23,665,600
秋田銀行	8,700	1,411.00	12,275,700
山形銀行	16,000	860.00	13,760,000
岩手銀行	9,400	1,716.00	16,130,400

東邦銀行	128,800	212.00	27,305,600
東北銀行	7,100	1,010.00	7,171,000
みちのく銀行	9,200	914.00	8,408,800
ふくおかフィナンシャルグループ	129,800	1,876.00	243,504,800
静岡銀行	350,400	831.00	291,182,400
十六銀行	18,100	1,953.00	35,349,300
スルガ銀行	125,800	326.00	41,010,800
八十二銀行	324,000	359.00	116,316,000
山梨中央銀行	16,700	825.00	13,777,500
大垣共立銀行	28,500	1,870.00	53,295,000
福井銀行	12,500	1,396.00	17,450,000
北國銀行	13,800	2,132.00	29,421,600
清水銀行	6,100	1,542.00	9,406,200
富山銀行	2,500	2,257.00	5,642,500
滋賀銀行	28,600	1,934.00	55,312,400
南都銀行	20,800	1,874.00	38,979,200
百五銀行	130,200	310.00	40,362,000
京都銀行	51,400	4,955.00	254,687,000
紀陽銀行	51,200	1,502.00	76,902,400
ほくほくフィナンシャルグループ	95,400	806.00	76,892,400
山陰合同銀行	90,900	547.00	49,722,300
中国銀行	123,900	870.00	107,793,000
鳥取銀行	4,700	1,118.00	5,254,600
伊予銀行	190,900	546.00	104,231,400
百十四銀行	15,200	1,511.00	22,967,200
四国銀行	20,300	702.00	14,250,600
阿波銀行	21,900	2,051.00	44,916,900
大分銀行	8,300	1,703.00	14,134,900
宮崎銀行	9,000	2,004.00	18,036,000
佐賀銀行	8,300	1,372.00	11,387,600
沖縄銀行	13,200	2,548.00	33,633,600
琉球銀行	31,500	716.00	22,554,000
セブン銀行	480,300	234.00	112,390,200
みずほフィナンシャルグループ	1,955,100	1,586.50	3,101,766,150
高知銀行	5,000	807.00	4,035,000
山口フィナンシャルグループ	179,600	633.00	113,686,800
芙蓉総合リース	15,200	7,080.00	107,616,000
みずほリース	22,100	3,605.00	79,670,500
東京センチュリー	33,400	6,000.00	200,400,000
SBIホールディングス	176,400	2,630.00	463,932,000
日本証券金融	61,000	824.00	50,264,000
アイフル	240,800	371.00	89,336,800
日本アジア投資	10,700	279.00	2,985,300
長野銀行	4,800	1,087.00	5,217,600
名古屋銀行	11,700	2,522.00	29,507,400
北洋銀行	217,100	239.00	51,886,900
愛知銀行	4,800	2,831.00	13,588,800
中京銀行	5,200	1,430.00	7,436,000
大光銀行	4,400	1,319.00	5,803,600
愛媛銀行	20,300	766.00	15,549,800

トマト銀行	5,600	1,032.00	5,779,200	
京葉銀行	61,600	411.00	25,317,600	
栃木銀行	68,900	172.00	11,850,800	
北日本銀行	4,600	1,628.00	7,488,800	
東和銀行	25,000	497.00	12,425,000	
福島銀行	16,300	237.00	3,863,100	
大東銀行	7,100	613.00	4,352,300	
リコーリース	11,300	3,460.00	39,098,000	
イオンフィナンシャルサービス	88,000	1,382.00	121,616,000	
アコム	289,500	470.00	136,065,000	
ジャックス	15,900	2,575.00	40,942,500	
オリエントコーポレーション	388,500	148.00	57,498,000	
オリックス	873,700	1,890.50	1,651,729,850	
三菱HCキャピタル	496,700	600.00	298,020,000	
ジャフコ グループ	20,600	6,460.00	133,076,000	
九州リースサービス	7,800	649.00	5,062,200	
トモニホールディングス	111,000	297.00	32,967,000	
大和証券グループ本社	1,077,800	575.80	620,597,240	
野村ホールディングス	2,196,600	552.20	1,212,962,520	
岡三証券グループ	122,700	422.00	51,779,400	
丸三証券	42,900	621.00	26,640,900	
東洋証券	47,000	158.00	7,426,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	153,100	393.00	60,168,300	
光世証券	3,500	588.00	2,058,000	
水戸証券	38,100	300.00	11,430,000	
いちよし証券	28,400	592.00	16,812,800	
松井証券	70,600	819.00	57,821,400	
SOMPOホールディングス	253,900	4,341.00	1,102,179,900	
日本取引所グループ	388,500	2,509.50	974,940,750	
マネックスグループ	129,100	719.00	92,822,900	
極東証券	19,300	835.00	16,115,500	
岩井コスモホールディングス	14,900	1,673.00	24,927,700	
藍澤證券	26,000	1,060.00	27,560,000	
フィデアホールディングス	139,700	122.00	17,043,400	
池田泉州ホールディングス	165,000	160.00	26,400,000	
アニコム ホールディングス	40,500	899.00	36,409,500	
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	349,600	3,309.00	1,156,826,400	
マネーパートナーズグループ	15,700	226.00	3,548,200	
スパークス・グループ	66,000	254.00	16,764,000	
小林洋行	3,100	268.00	830,800	
第一生命ホールディングス	708,000	1,962.00	1,389,096,000	
東京海上ホールディングス	473,700	5,139.00	2,434,344,300	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,700	1,106.00	7,410,200	
イー・ギャランティ	16,600	2,376.00	39,441,600	
アサックス	7,900	684.00	5,403,600	
NECキャピタルソリューション	5,900	2,162.00	12,755,800	
T & Dホールディングス	429,900	1,407.00	604,869,300	
アドバンスクリエイト	5,900	980.00	5,782,000	

三井不動産	655,500	2,686.00	1,760,673,000
三菱地所	944,800	1,781.50	1,683,161,200
平和不動産	24,700	3,805.00	93,983,500
東京建物	141,700	1,648.00	233,521,600
ダイビル	37,300	1,439.00	53,674,700
京阪神ビルディング	24,900	1,432.00	35,656,800
住友不動産	323,500	3,842.00	1,242,887,000
太平洋興発	6,300	641.00	4,038,300
テーオーシー	28,800	677.00	19,497,600
東京楽天地	2,700	4,150.00	11,205,000
レオパレス21	102,900	151.00	15,537,900
スターツコーポレーション	17,000	2,898.00	49,266,000
フジ住宅	16,700	634.00	10,587,800
空港施設	15,300	588.00	8,996,400
明和地所	6,800	630.00	4,284,000
ゴールドクレスト	13,000	1,680.00	21,840,000
リログループ	76,100	2,474.00	188,271,400
エスリード	5,800	1,600.00	9,280,000
日神グループホールディングス	21,400	466.00	9,972,400
日本エスコン	26,200	773.00	20,252,600
タカラレーベン	61,100	346.00	21,140,600
A V A N T I A	8,200	910.00	7,462,000
イオンモール	71,900	1,678.00	120,648,200
毎日コムネット	4,200	731.00	3,070,200
ファースト住建	6,200	1,169.00	7,247,800
ランド	666,300	12.00	7,995,600
カチタス	35,600	3,260.00	116,056,000
東祥	8,900	1,961.00	17,452,900
トーセイ	20,000	1,199.00	23,980,000
穴吹興産	3,000	1,982.00	5,946,000
サンフロンティア不動産	17,600	1,098.00	19,324,800
エフ・ジェー・ネクスト	14,300	1,037.00	14,829,100
インテリックス	3,100	710.00	2,201,000
ランドビジネス	5,500	330.00	1,815,000
サンネクスタグループ	4,600	985.00	4,531,000
グランディハウス	10,000	431.00	4,310,000
東武鉄道	152,000	2,925.00	444,600,000
相鉄ホールディングス	50,200	2,211.00	110,992,200
東急	367,900	1,582.00	582,017,800
京浜急行電鉄	187,200	1,391.00	260,395,200
小田急電鉄	233,500	2,842.00	663,607,000
京王電鉄	81,600	6,560.00	535,296,000
京成電鉄	109,100	3,645.00	397,669,500
富士急行	19,800	5,170.00	102,366,000
新京成電鉄	3,500	2,114.00	7,399,000
東日本旅客鉄道	256,800	8,099.00	2,079,823,200
西日本旅客鉄道	130,100	6,516.00	847,731,600
東海旅客鉄道	121,100	17,185.00	2,081,103,500
西武ホールディングス	175,900	1,350.00	237,465,000
鴻池運輸	23,500	1,222.00	28,717,000

西日本鉄道	40,400	2,757.00	111,382,800
ハマキョウレックス	11,200	3,220.00	36,064,000
サカイ引越センター	6,700	5,780.00	38,726,000
近鉄グループホールディングス	137,900	4,000.00	551,600,000
阪急阪神ホールディングス	184,000	3,505.00	644,920,000
南海電気鉄道	65,600	2,407.00	157,899,200
京阪ホールディングス	61,700	3,365.00	207,620,500
神戸電鉄	3,400	3,530.00	12,002,000
名古屋鉄道	113,500	2,050.00	232,675,000
山陽電気鉄道	10,100	1,938.00	19,573,800
アルプス物流	9,500	948.00	9,006,000
トランコム	4,200	8,500.00	35,700,000
日本通運	48,000	8,240.00	395,520,000
ヤマトホールディングス	193,600	3,370.00	652,432,000
山九	35,400	5,000.00	177,000,000
日新	11,000	1,505.00	16,555,000
丸運	9,100	273.00	2,484,300
丸全昭和運輸	11,200	3,285.00	36,792,000
センコーグループホールディングス	76,400	1,082.00	82,664,800
トナミホールディングス	2,900	5,180.00	15,022,000
ニッコンホールディングス	46,500	2,418.00	112,437,000
日本石油輸送	1,000	2,588.00	2,588,000
福山通運	17,700	4,130.00	73,101,000
セイノーホールディングス	103,400	1,402.00	144,966,800
エスライン	3,600	910.00	3,276,000
神奈川中央交通	2,900	3,560.00	10,324,000
日立物流	30,400	4,500.00	136,800,000
丸和運輸機関	29,100	1,533.00	44,610,300
C & F ロジホールディングス	14,200	1,605.00	22,791,000
日本郵船	115,500	5,270.00	608,685,000
商船三井	82,100	4,980.00	408,858,000
川崎汽船	42,600	3,550.00	151,230,000
NSユナイテッド海運	6,800	2,278.00	15,490,400
明治海運	13,100	473.00	6,196,300
飯野海運	64,600	428.00	27,648,800
共栄タンカー	2,800	864.00	2,419,200
九州旅客鉄道	106,700	2,593.00	276,673,100
S Gホールディングス	261,200	3,015.00	787,518,000
日本航空	336,500	2,471.00	831,491,500
ANAホールディングス	372,900	2,724.00	1,015,779,600
パスコ	2,800	1,530.00	4,284,000
西本Wismettacホールディングス	3,000	2,749.00	8,247,000
シルバーライフ	2,800	2,059.00	5,765,200
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,999.00	2,398,800
一家ダイニングプロジェクト	1,000	592.00	592,000
Genky DrugStores	6,400	4,095.00	26,208,000
コア商事ホールディングス	8,000	665.00	5,320,000
国際紙パルプ商事	31,200	259.00	8,080,800
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	1,119.00	3,245,100

ブックオフグループホールディングス	8,300	972.00	8,067,600	
ギフト	1,200	2,416.00	2,899,200	
三菱倉庫	47,800	3,330.00	159,174,000	
三井倉庫ホールディングス	14,800	2,595.00	38,406,000	
住友倉庫	49,900	1,589.00	79,291,100	
澁澤倉庫	7,600	2,137.00	16,241,200	
ヤマタネ	6,400	1,538.00	9,843,200	
東陽倉庫	20,700	316.00	6,541,200	
乾汽船	9,000	1,224.00	11,016,000	
日本トランスシティ	30,800	557.00	17,155,600	
ケイヒン	2,100	1,367.00	2,870,700	
中央倉庫	7,900	1,017.00	8,034,300	
川西倉庫	2,700	1,158.00	3,126,600	
安田倉庫	12,200	954.00	11,638,800	
ファイズホールディングス	2,600	799.00	2,077,400	
東洋埠頭	3,600	1,481.00	5,331,600	
宇徳	10,400	532.00	5,532,800	
上組	77,000	2,312.00	178,024,000	
サンリツ	2,900	762.00	2,209,800	
キムラユニティー	4,200	1,305.00	5,481,000	
キューソー流通システム	3,400	1,690.00	5,746,000	
近鉄エクスプレス	26,300	2,546.00	66,959,800	
東海運	9,300	310.00	2,883,000	
エーアイティー	8,700	1,098.00	9,552,600	
内外トランスライン	4,800	1,937.00	9,297,600	
ショーエイコーポレーション	3,000	964.00	2,892,000	
日本コンセプト	4,600	1,832.00	8,427,200	
TBSホールディングス	95,000	1,735.00	164,825,000	
日本テレビホールディングス	119,200	1,277.00	152,218,400	
朝日放送グループホールディングス	15,200	706.00	10,731,200	
テレビ朝日ホールディングス	44,400	1,743.00	77,389,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	94,300	412.00	38,851,600	
テレビ東京ホールディングス	10,500	2,148.00	22,554,000	
日本BS放送	4,800	1,099.00	5,275,200	
ビジョン	17,800	1,083.00	19,277,400	
スマートバリュー	3,600	677.00	2,437,200	
USEN-NEXT HOLDINGS	13,700	2,815.00	38,565,500	
ワイヤレスゲート	5,200	434.00	2,256,800	
コネクシオ	8,500	1,564.00	13,294,000	
日本通信	108,800	221.00	24,044,800	
クロップス	2,800	887.00	2,483,600	
日本電信電話	1,674,500	2,882.00	4,825,909,000	
KDDI	1,148,100	3,492.00	4,009,165,200	
ソフトバンク	1,301,100	1,470.00	1,912,617,000	
光通信	16,900	20,610.00	348,309,000	
エムティーアイ	14,100	689.00	9,714,900	
GMOインターネット	51,300	2,997.00	153,746,100	
ファイバーゲート	4,700	1,481.00	6,960,700	



アйдママーケティングコミュニケーション	3,600	402.00	1,447,200	
KADOKAWA	37,100	4,300.00	159,530,000	
学研ホールディングス	19,300	1,334.00	25,746,200	
ゼンリン	26,300	1,151.00	30,271,300	
昭文社ホールディングス	5,400	490.00	2,646,000	
インプレスホールディングス	12,300	246.00	3,025,800	
東京電力ホールディングス	1,236,900	329.00	406,940,100	
中部電力	446,400	1,336.00	596,390,400	
関西電力	552,900	1,047.00	578,886,300	
中国電力	210,700	1,017.00	214,281,900	
北陸電力	133,600	610.00	81,496,000	
東北電力	341,500	861.00	294,031,500	
四国電力	121,100	754.00	91,309,400	
九州電力	322,100	842.00	271,208,200	
北海道電力	136,400	514.00	70,109,600	
沖縄電力	28,500	1,421.00	40,498,500	
電源開発	115,900	1,624.00	188,221,600	
エフオン	8,900	980.00	8,722,000	
イーレックス	21,300	2,937.00	62,558,100	
レノバ	24,600	4,885.00	120,171,000	
東京瓦斯	280,500	2,058.50	577,409,250	
大阪瓦斯	264,200	2,024.00	534,740,800	
東邦瓦斯	71,700	5,560.00	398,652,000	
北海道瓦斯	8,000	1,585.00	12,680,000	
広島ガス	30,800	377.00	11,611,600	
西部ガスホールディングス	16,600	2,515.00	41,749,000	
静岡ガス	41,500	1,064.00	44,156,000	
メタウォーター	16,700	2,048.00	34,201,600	
アイネット	7,300	1,460.00	10,658,000	
松竹	9,400	12,690.00	119,286,000	
東宝	84,500	4,640.00	392,080,000	
エイチ・アイ・エス	21,500	2,600.00	55,900,000	
東映	4,700	20,290.00	95,363,000	
ラックランド	3,900	2,702.00	10,537,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	381,400	1,754.00	668,975,600	
共立メンテナンス	23,100	3,875.00	89,512,500	
イチネンホールディングス	14,800	1,237.00	18,307,600	
建設技術研究所	9,100	2,345.00	21,339,500	
スペース	9,400	900.00	8,460,000	
長大	5,600	1,945.00	10,892,000	
アインホールディングス	20,600	6,650.00	136,990,000	
燦ホールディングス	5,800	1,239.00	7,186,200	
ピー・シー・エー	2,000	3,885.00	7,770,000	
スバル興業	900	8,170.00	7,353,000	
東京テアトル	5,700	1,258.00	7,170,600	
タナベ経営	2,800	1,422.00	3,981,600	
ビジネスブレイン太田昭和	4,800	1,762.00	8,457,600	
ナガワ	4,500	8,710.00	39,195,000	
東京都競馬	9,100	4,540.00	41,314,000	

常磐興産	5,800	1,434.00	8,317,200	
カナモト	24,700	2,564.00	63,330,800	
D T S	29,700	2,722.00	80,843,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	61,200	5,280.00	323,136,000	
シーイーシー	15,200	1,637.00	24,882,400	
カブコン	122,900	3,095.00	380,375,500	
西尾レントオール	12,800	3,075.00	39,360,000	
アイ・エス・ピー	6,500	1,532.00	9,958,000	
アゴーラ ホスピタリティグループ	75,800	26.00	1,970,800	
日本空港ビルディング	49,500	5,230.00	258,885,000	
トランス・コスモス	13,500	3,115.00	42,052,500	
乃村工藝社	59,800	885.00	52,923,000	
ジャステック	9,200	1,243.00	11,435,600	
S C S K	32,800	6,830.00	224,024,000	
藤田観光	5,700	2,308.00	13,155,600	
K N T - C Tホールディングス	6,400	1,318.00	8,435,200	
日本管財	15,200	2,567.00	39,018,400	
トーカイ	13,900	2,426.00	33,721,400	
白洋舎	900	2,234.00	2,010,600	
セコム	137,400	8,521.00	1,170,785,400	
日本システムウエア	4,700	2,324.00	10,922,800	
セントラル警備保障	6,700	3,070.00	20,569,000	
アイネス	14,100	1,408.00	19,852,800	
丹青社	26,200	882.00	23,108,400	
メイテック	17,000	6,210.00	105,570,000	
T K C	24,200	3,360.00	81,312,000	
富士ソフト	15,300	5,680.00	86,904,000	
応用地質	16,400	1,304.00	21,385,600	
船井総研ホールディングス	28,500	2,497.00	71,164,500	
N S D	46,200	1,853.00	85,608,600	
進学会ホールディングス	6,000	424.00	2,544,000	
丸紅建材リース	1,000	1,895.00	1,895,000	
オオバ	9,700	826.00	8,012,200	
コナミホールディングス	52,100	6,300.00	328,230,000	
いであ	3,000	1,807.00	5,421,000	
学究社	4,200	1,363.00	5,724,600	
ベネッセホールディングス	51,200	2,753.00	140,953,600	
イオンディライト	17,100	3,640.00	62,244,000	
ナック	6,700	915.00	6,130,500	
福井コンピュータホールディングス	6,500	4,305.00	27,982,500	
ダイセキ	23,400	4,895.00	114,543,000	
ステップ	5,200	1,675.00	8,710,000	
日鉄物産	10,300	4,470.00	46,041,000	
泉州電業	3,900	3,850.00	15,015,000	
元気寿司	4,000	2,546.00	10,184,000	
トラスコ中山	32,700	2,824.00	92,344,800	
ヤマダホールディングス	481,600	502.00	241,763,200	
オートバックスセブン	53,100	1,545.00	82,039,500	

モリト	10,800	615.00	6,642,000	
アークランドサカモト	22,500	1,474.00	33,165,000	
ニトリホールディングス	57,200	19,695.00	1,126,554,000	
グルメ杵屋	10,500	969.00	10,174,500	
愛眼	9,800	226.00	2,214,800	
ケーユーホールディングス	7,300	960.00	7,008,000	
吉野家ホールディングス	47,100	2,142.00	100,888,200	
加藤産業	20,600	3,380.00	69,628,000	
北恵	3,800	972.00	3,693,600	
イノテック	8,200	1,367.00	11,209,400	
イエローハット	27,000	2,054.00	55,458,000	
松屋フーズホールディングス	6,800	3,610.00	24,548,000	
JBCホールディングス	9,700	1,476.00	14,317,200	
JKホールディングス	13,000	815.00	10,595,000	
サガミホールディングス	19,500	1,024.00	19,968,000	
日伝	12,200	2,192.00	26,742,400	
関西スーパーマーケット	10,800	992.00	10,713,600	
ミロク情報サービス	14,300	1,725.00	24,667,500	
北沢産業	9,100	251.00	2,284,100	
杉本商事	7,300	2,291.00	16,724,300	
因幡電機産業	38,200	2,637.00	100,733,400	
王将フードサービス	9,500	5,840.00	55,480,000	
プレナス	16,300	2,075.00	33,822,500	
ミニストップ	10,800	1,393.00	15,044,400	
アークス	27,300	2,218.00	60,551,400	
パローホールディングス	29,400	2,206.00	64,856,400	
東テク	4,800	2,818.00	13,526,400	
ミスミグループ本社	179,900	3,985.00	716,901,500	
藤久	3,000	729.00	2,187,000	
アルテック	10,800	318.00	3,434,400	
ベルク	7,000	5,180.00	36,260,000	
大 庄	8,000	1,067.00	8,536,000	
タキヒヨー	4,800	1,893.00	9,086,400	
ファーストリテイリング	19,200	80,610.00	1,547,712,000	
ソフトバンクグループ	1,135,900	7,540.00	8,564,686,000	
蔵王産業	2,500	1,508.00	3,770,000	
スズケン	60,700	3,350.00	203,345,000	
サンドラッグ	54,000	3,485.00	188,190,000	
サックスパー ホールディングス	12,600	617.00	7,774,200	
ジェコス	10,300	897.00	9,239,100	
ヤマザワ	3,000	1,705.00	5,115,000	
やまや	2,900	2,315.00	6,713,500	
グローセル	15,900	440.00	6,996,000	
ペルーナ	30,700	932.00	28,612,400	
合計	154,536,300		390,836,860,540	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年7月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,271,114,534
国債証券	146,028,231,716
派生商品評価勘定	1,538,805
未収入金	568,929,855
未収利息	780,973,742
前払費用	56,195,863
流動資産合計	148,706,984,515
資産合計	148,706,984,515
負債の部	
流動負債	
前受金	272,506,046
未払金	341,908,724
未払解約金	683,114,000
流動負債合計	1,297,528,770
負債合計	1,297,528,770
純資産の部	
元本等	
元本	71,842,982,169
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	75,566,473,576
元本等合計	147,409,455,745
純資産合計	147,409,455,745
負債純資産合計	148,706,984,515

## 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1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年7月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	67,292,412,269円
同期中追加設定元本額	17,490,264,772円
同期中一部解約元本額	12,939,694,872円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,715,987,094円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	5,047,543円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	21,988,657円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	17,878,958円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	66,463,112円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	38,761,745円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	23,623,554円
たわらノーロード 先進国債券	11,267,773,877円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	201,424,928円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,239,932,035円
たわらノーロード バランス（堅実型）	35,475,903円
たわらノーロード バランス（標準型）	165,839,781円
たわらノーロード バランス（積極型）	34,127,377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）	5,520,606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）	263,898,827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）	264,718,017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）	58,376,863円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	167,554円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,948,809円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	11,896,549円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,980,312円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,018,394円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,083,009,322円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	515,325,396円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	663,734,175円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,972,794,733円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,170,948,617円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	384,724,603円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	787,046,970円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	678,554,234円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,398,368円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	454,142,483円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,315,532円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,346,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	114,366,554円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	194,932,054円
クルーズコントロール	1,109,737,016円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	115,575,378円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	265,165,979円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	4,103,295円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	10,754,086円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	156,582,122円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	163,045,599円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	25,699,646円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,203,086,501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)	205,033,934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)	251,290,165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)	102,319,415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)	126,767,407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)	199,972,627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)	1,416,645,424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)	437,840,710円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,559,625,058円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,209,961,849円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,520,707,571円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,411,703,058円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	56,754,364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)	334,724,185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)	464,917,474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)	268,367,779円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	21,502,317円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	45,392,835円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,750,032円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,030,980円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	32,826,852円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	59,228,066円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,222,754,066円

D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,706,576,784円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,994,581,503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)	226,528,926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)	186,201,216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)	2,063,037,702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)	489,025,340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)	3,639,854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)	427,416,843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)	430,059,350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)	597,241,983円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	63,673,368円
計	71,842,982,169円
2. 受益権の総数	71,842,982,169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1月13日 至 2021年7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。



2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		552,188,858
合計		552,188,858

(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(2021年2月23日から2021年7月12日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	360,000,000	-	361,538,805	1,538,805
イギリス・ポンド	174,302,000	-	174,712,262	410,262
ユーロ	34,957,000	-	35,315,369	358,369
ユーロ	150,741,000	-	151,511,174	770,174
合計	360,000,000	-	361,538,805	1,538,805

## (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)

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0518円 (20,518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

2021年7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	5,000,000.000	4,975,390.600	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,000,000.000	3,979,687.480	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,000,000.000	2,996,132.820	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,596,812.490	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,000,000.000	1,995,390.620	
		US T N/B 0.125 08/31/22	4,000,000.000	4,001,093.720	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,994,375.000	
		US T N/B 0.125 09/30/22	7,030,000.000	7,030,000.000	
		US T N/B 0.125 11/30/22	5,340,000.000	5,337,705.450	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,000,000.000	1,992,187.500	
		US T N/B 0.25 03/15/24	4,810,000.000	4,797,975.000	
		US T N/B 0.25 04/15/23	2,000,000.000	2,002,500.000	
		US T N/B 0.25 05/15/24	5,000,000.000	4,981,445.300	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,470,000.000	4,410,108.970	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,802,187.500	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,957,578.110	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	984,765.620	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,000,000.000	983,710.930	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,000,000.000	2,948,789.040	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,963,984.360	
		US T N/B 0.375 01/31/26	4,000,000.000	3,938,281.240	
		US T N/B 0.375 04/15/24	5,000,000.000	5,001,562.500	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,000,000.000	1,985,195.320	
		US T N/B 0.375 07/31/27	2,000,000.000	1,930,234.360	
		US T N/B 0.375 09/30/27	4,450,000.000	4,282,777.310	
		US T N/B 0.375 11/30/25	2,590,000.000	2,554,488.660	
		US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,956,640.610	
US T N/B 0.5 02/28/26	3,870,000.000	3,829,637.090			
US T N/B 0.5 03/15/23	2,000,000.000	2,011,250.000			

US T N/B 0.5 03/31/25	800,000.000	798,515.620	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,951,953.120	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,461,269.520	
US T N/B 0.5 06/30/27	1,700,000.000	1,654,644.520	
US T N/B 0.5 08/31/27	2,000,000.000	1,942,343.740	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,904,726.540	
US T N/B 0.625 03/31/27	1,800,000.000	1,771,875.000	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,220,000.000	4,925,559.370	
US T N/B 0.625 08/15/30	6,210,000.000	5,842,736.680	
US T N/B 0.625 11/30/27	2,000,000.000	1,950,078.120	
US T N/B 0.625 12/31/27	2,430,000.000	2,366,497.270	
US T N/B 0.75 01/31/28	3,390,000.000	3,325,907.810	
US T N/B 0.75 03/31/26	2,570,000.000	2,571,104.270	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,000,000.000	3,000,234.360	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,000,000.000	2,998,125.000	
US T N/B 0.875 06/30/26	2,810,000.000	2,822,403.500	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,900,000.000	8,545,738.250	
US T N/B 1.125 02/15/31	6,860,000.000	6,724,139.810	
US T N/B 1.125 02/28/25	1,000,000.000	1,021,054.680	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,114,287.020	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,020,000.000	3,032,976.540	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,844,062.500	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,500,000.000	3,064,414.030	
US T N/B 1.25 03/31/28	2,910,000.000	2,942,282.810	
US T N/B 1.25 04/30/28	3,170,000.000	3,203,805.070	
US T N/B 1.25 05/15/50	3,780,000.000	3,152,091.790	
US T N/B 1.25 05/31/28	1,500,000.000	1,515,527.340	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,000,000.000	3,027,421.860	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,502,715.610	
US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,377,887.500	
US T N/B 1.375 02/15/23	4,000,000.000	4,077,656.240	
US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,538,660.920	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,540,000.000	3,907,414.820	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,131,625.000	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,500,000.000	1,536,972.640	
US T N/B 1.375 11/15/40	3,810,000.000	3,484,066.380	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,490,000.000	2,573,648.430	
US T N/B 1.5 02/15/30	3,970,000.000	4,043,507.000	
US T N/B 1.5 02/28/23	1,000,000.000	1,021,523.430	
US T N/B 1.5 03/31/23	2,000,000.000	2,045,000.000	
US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,228,386.320	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,090,000.000	3,198,994.890	
US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	762,246.090	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,200,000.000	2,275,023.430	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,000,000.000	2,068,437.500	
US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,349,159.370	
US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,075,937.500	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,090,000.000	3,216,255.450	
US T N/B 1.625 05/15/31	1,380,000.000	1,414,122.650	

US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,977,824.190	
US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	4,046,385.120	
US T N/B 1.625 08/15/29	1,380,000.000	1,423,178.900	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,900,000.000	1,977,484.370	
US T N/B 1.625 10/31/23	4,000,000.000	4,124,218.720	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,446,386.700	
US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,731,082.780	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,400,000.000	4,033,390.580	
US T N/B 1.625 11/30/26	4,160,000.000	4,330,624.970	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,103,916.390	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,693,585.130	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,393,652.340	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,840,482.810	
US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,355,000.000	
US T N/B 1.75 11/15/29	1,940,000.000	2,018,964.040	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,600,000.000	1,668,750.000	
US T N/B 1.75 12/31/26	1,740,000.000	1,823,193.750	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,110,000.000	4,091,697.620	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,420,000.000	4,303,111.670	
US T N/B 1.875 06/30/26	450,000.000	473,958.980	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,497,017.180	
US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,752,737.480	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,259,912.500	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,495,978.880	
US T N/B 2.0 02/15/25	4,300,000.000	4,524,742.160	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,270,000.000	3,276,003.470	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,991,544.120	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,466,114.030	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,390,340.620	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,757,581.590	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,361,039.050	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,275,234.360	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,320,000.000	3,514,401.530	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,183,169.900	
US T N/B 2.125 06/30/22	2,000,000.000	2,039,218.740	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,086,571.870	
US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	2,087,109.360	
US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,680,856.220	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	367,212.880	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,814,863.260	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,306,179.270	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,472,992.170	
US T N/B 2.25 05/15/41	1,390,000.000	1,469,327.730	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	2,894,166.770	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,710,000.000	1,800,175.760	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,400,000.000	3,589,390.600	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	4,966,453.490	
US T N/B 2.25 11/15/25	4,690,000.000	5,005,658.940	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,520,487.100	

US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	3,181,054.680	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,894,887.490	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,100,000.000	3,356,355.460	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	3,056,533.570	
US T N/B 2.375 05/15/51	4,100,000.000	4,461,792.930	
US T N/B 2.375 08/15/24	3,920,000.000	4,156,578.110	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	3,005,125.370	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,106,533.190	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,080,000.000	2,288,650.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,171,771.070	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,755,195.310	
US T N/B 2.5 03/31/23	3,020,000.000	3,140,328.120	
US T N/B 2.5 05/15/24	4,240,000.000	4,497,050.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,810,000.000	1,995,736.950	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,534,491.000	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,366,236.700	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,543,155.430	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,800,000.000	1,872,421.860	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,314,357.410	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,905,881.250	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,234,515.620	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,484,023.820	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,653,123.390	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	4,844,383.930	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,792,410.920	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,603,022.640	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,426,730.050	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	856,409.370	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,439,375.760	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,330,000.000	1,521,810.930	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,175,439.040	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,285,535.530	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,782,090.610	
US T N/B 2.75 11/15/23	5,520,000.000	5,839,771.830	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,220,000.000	1,396,042.170	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,140,000.000	2,478,471.070	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	4,953,639.810	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,000,000.000	1,167,812.500	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	3,682,773.000	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,752,956.250	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	2,027,327.320	
US T N/B 2.875 08/15/28	3,680,000.000	4,120,881.210	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,890,000.000	2,222,226.560	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	888,693.750	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,910,102.700	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,440,000.000	1,700,212.480	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,640,000.000	1,982,350.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	3,080,047.630	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,739,643.750	

US T N/B 3.0 05/15/42		980,000.000	1,165,281.250	
US T N/B 3.0 05/15/45		1,300,000.000	1,558,425.770	
US T N/B 3.0 05/15/47		1,290,000.000	1,559,841.780	
US T N/B 3.0 08/15/48		2,710,000.000	3,294,132.000	
US T N/B 3.0 09/30/25		1,410,000.000	1,547,364.830	
US T N/B 3.0 10/31/25		1,920,000.000	2,109,524.980	
US T N/B 3.0 11/15/44		1,790,000.000	2,142,685.930	
US T N/B 3.0 11/15/45		650,000.000	781,294.910	
US T N/B 3.125 02/15/42		680,000.000	823,915.620	
US T N/B 3.125 02/15/43		1,440,000.000	1,747,012.490	
US T N/B 3.125 05/15/48		2,060,000.000	2,556,331.240	
US T N/B 3.125 08/15/44		1,750,000.000	2,135,000.000	
US T N/B 3.125 11/15/28		6,170,000.000	7,027,292.560	
US T N/B 3.125 11/15/41		760,000.000	919,659.370	
US T N/B 3.375 05/15/44		1,530,000.000	1,938,019.900	
US T N/B 3.375 11/15/48		2,660,000.000	3,454,778.880	
US T N/B 3.5 02/15/39		900,000.000	1,141,312.500	
US T N/B 3.625 02/15/44		1,630,000.000	2,138,419.910	
US T N/B 3.625 08/15/43		1,170,000.000	1,529,135.140	
US T N/B 3.75 08/15/41		710,000.000	935,702.330	
US T N/B 3.75 11/15/43		1,360,000.000	1,812,465.620	
US T N/B 3.875 08/15/40		1,110,000.000	1,479,421.870	
US T N/B 4.25 05/15/39		810,000.000	1,123,368.750	
US T N/B 4.25 11/15/40		510,000.000	713,402.340	
US T N/B 4.375 02/15/38		550,000.000	766,734.370	
US T N/B 4.375 05/15/40		1,200,000.000	1,698,843.740	
US T N/B 4.375 05/15/41		1,040,000.000	1,481,431.240	
US T N/B 4.375 11/15/39		910,000.000	1,282,886.710	
US T N/B 4.5 02/15/36		730,000.000	1,013,103.120	
US T N/B 4.5 05/15/38		540,000.000	763,994.520	
US T N/B 4.5 08/15/39		790,000.000	1,128,712.500	
US T N/B 4.625 02/15/40		750,000.000	1,090,546.870	
US T N/B 4.75 02/15/41		1,200,000.000	1,783,125.000	
US T N/B 5.0 05/15/37		500,000.000	737,226.560	
US T N/B 5.25 11/15/28		850,000.000	1,098,359.370	
US T N/B 5.375 02/15/31		700,000.000	958,562.500	
US T N/B 5.5 08/15/28		650,000.000	846,421.870	
US T N/B 6.0 02/15/26		840,000.000	1,040,943.750	
US T N/B 6.125 11/15/27		900,000.000	1,184,906.250	
US T N/B 6.25 05/15/30		710,000.000	1,008,200.000	
US T N/B 6.25 08/15/23		1,000,000.000	1,125,742.180	
アメリカ・ドル	小計	575,360,000.000 (63,387,411,200)	603,519,765.060 (66,489,772,514)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,200,000.000	1,190,760.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,501,005.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,798,470.000	

UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,000,000.000	977,250.000	
UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,150,000.000	1,093,581.000	
UK TREASURY 0.375 10/22/26	700,000.000	699,797.000	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,020,000.000	991,644.000	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	770,000.000	621,698.000	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,550,000.000	1,575,142.850	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,800,000.000	1,711,692.000	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	860,000.000	743,662.640	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,581,592.890	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	450,000.000	419,881.500	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	910,000.000	930,516.860	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,120,000.000	1,147,092.800	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	700,000.000	735,525.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	390,000.000	396,591.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,340,000.000	1,365,366.200	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	953,406.900	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,030,000.000	1,104,530.800	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	1,005,615.510	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	920,000.000	1,037,506.800	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	500,000.000	619,750.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	579,566.650	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,010,000.000	1,193,961.400	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	1,530,000.000	1,559,634.260	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,440,000.000	1,589,083.200	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	848,017.600	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,235,231.550	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,465,031.400	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	519,069.210	

	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,310,000.000	1,852,864.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	1,895,669.760	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,821,408.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	590,000.000	987,477.100	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	870,000.000	1,658,402.700	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	940,000.000	1,361,073.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,010,000.000	1,376,482.130	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	820,000.000	1,249,680.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	968,708.980	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,489,031.800	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,776,591.800	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	850,000.000	1,486,061.460	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	1,920,996.600	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	760,000.000	1,099,552.180	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,180,000.000	1,935,523.790	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	870,000.000	1,194,440.400	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,400,507.320	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,410,000.000	1,656,482.100	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,062,286.960	
	イギリス・ボンド 小計	50,330,000.000 (7,706,026,300)	61,384,914.100 (9,398,644,198)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22	300,000.000	302,214.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,350,000.000	1,345,816.350	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	1,000,000.000	1,016,035.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,000,000.000	961,163.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,147,737.970	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,822,508.810	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,160,000.000	1,278,679.600	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,852,239.000	



	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,390,000.000	1,813,178.550	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,920,000.000	3,127,086.400	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,500,000.000	2,404,887.000	
イスラエル・シュケル 小計		17,860,000.000 (600,497,850)	20,071,545.680 (674,855,545)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,440,000.000	1,435,036.610	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,430,361.380	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,180,000.000	1,165,664.380	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,544,665.630	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	2,360,000.000	2,299,393.100	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	990,000.000	975,857.150	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,640,000.000	1,667,594.640	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	800,000.000	720,800.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	600,000.000	619,978.800	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	980,000.000	1,060,213.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,050,000.000	2,270,798.720	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,125,151.220	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	832,137.470	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	605,732.170	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,630,000.000	1,813,538.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,160,000.000	1,299,850.640	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,753,596.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	1,020,280.400	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,200,000.000	1,325,892.600	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,640,000.000	1,902,528.740	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	748,747.960		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	969,979.560		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,351,324.130		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	980,000.000	1,306,791.190		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,800,000.000	3,070,168.920		
オーストラリア・ドル 小計		33,570,000.000 (2,765,160,900)	36,316,082.410 (2,991,355,708)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	500,000.000	498,762.000	
	CANADA 0.25 03/01/26	1,100,000.000	1,066,041.900	
	CANADA 0.25 04/01/24	2,000,000.000	1,978,098.000	
	CANADA 0.25 05/01/23	1,000,000.000	995,858.000	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,850,000.000	1,823,082.500	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,100,000.000	1,020,687.800	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	698,446.700	
	CANADA 1.0 09/01/22	1,500,000.000	1,511,622.000	
	CANADA 1.0 09/01/26	600,000.000	599,641.800	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	711,761.400	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,810,000.000	1,806,941.100	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,233,247.730	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	821,477.600	

	CANADA 1.5 06/01/31	800,000.000	809,525.600	
	CANADA 1.75 03/01/23	3,160,000.000	3,227,345.920	
	CANADA 2.0 06/01/28	720,000.000	762,243.120	
	CANADA 2.0 09/01/23	420,000.000	433,076.700	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,180,000.000	2,277,007.820	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	552,655.910	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,000,000.000	1,056,033.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	659,356.930	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,684,192.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	1,026,632.550	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	442,033.200	
	CANADA 3.5 12/01/45	820,000.000	1,101,497.800	
	CANADA 4.0 06/01/41	540,000.000	750,651.840	
	CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	576,721.860	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,000,000.000	1,342,500.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	520,000.000	761,221.240	
カナダ・ドル 小計		30,360,000.000 (2,685,038,400)	32,228,364.020 (2,850,276,514)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.75 02/01/23	200,000.000	204,237.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	400,000.000	408,726.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	200,000.000	207,580.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	420,000.000	445,273.500	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	511,644.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	362,032.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	180,000.000	197,064.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	130,000.000	142,480.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	494,550.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	440,420.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	731,990.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	470,000.000	527,105.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	417,175.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	590,975.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	700,000.000	722,120.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	573,120.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	829,572.000		
シンガポール・ドル 小計		7,150,000.000 (582,939,500)	7,806,063.500 (636,428,357)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,500,000.000	2,476,352.040	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,540,000.000	1,618,001.920	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	3,338,327.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,506,933.750	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	4,700,000.000	4,899,154.980	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,700,000.000	3,274,816.500	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,980,000.000	8,825,002.200	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,904,892.410	
スウェーデン・クローナ 小計		30,110,000.000 (386,913,500)	33,843,480.800 (434,888,728)	

デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	1,500,000.000	1,502,363.100	
	DENMARK 0.25 11/15/22	3,510,000.000	3,543,696.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,420,000.000	2,301,662.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,503,968.500	
	DENMARK 0.5 11/15/29	2,670,000.000	2,824,045.650	
	DENMARK 1.5 11/15/23	3,500,000.000	3,670,761.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,840,587.530	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,680,000.000	13,676,679.160	
デンマーク・クローネ 小計		33,730,000.000 (593,310,700)	40,863,763.440 (718,793,599)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,800,000.000	1,798,290.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,779,609.000	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,851,809.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,200,000.000	1,243,738.800	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,909,288.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,700,000.000	1,774,094.500	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,190,163.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,845,196.920	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,556,921.600	
ノルウェー・クローネ 小計		26,070,000.000 (330,828,300)	26,949,111.320 (341,984,223)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,400,000.000	1,323,980.000	
	POLAND 07/25/22	1,200,000.000	1,200,004.560	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,750,000.000	3,614,153.550	
	POLAND 2.25 10/25/24	1,000,000.000	1,047,276.200	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,850,000.000	2,948,316.450	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,408,851.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,180,000.000	2,312,769.190	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,550,000.000	2,709,630.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,010,000.000	3,263,592.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	228,931.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,588,452.300	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,440,000.000	4,801,726.800	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,879,992.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	820,000.000	875,924.000	
ポーランド・ズロチ 小計		29,520,000.000 (849,184,128)	31,203,600.050 (897,615,240)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,053,995.800	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,251,384.740	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,096,137.400	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,700,000.000	1,703,097.570	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,221,828.710	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	846,293.280	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,560,553.450	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,310,277.540	

	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,975,681.620	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,313,234.880	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,600,000.000	2,812,192.500	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,184,511.600	
マレーシア・リングgit 小計		23,030,000.000 (606,308,507)	24,329,189.090 (640,512,128)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	8,000,000.000	8,128,880.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,290,782.840	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	22,596,000.000	25,179,041.400	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	19,143,000.000	18,614,946.270	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,838,083.220	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	11,000,000.000	11,728,860.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,643,000.000	14,169,522.930	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,476,840.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	20,000,000.000	21,011,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	9,454,000.000	10,076,025.930	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,618,240.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	18,961,435.910	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	12,407,346.480	
	メキシコ・ペソ 小計		179,226,000.000 (993,234,647)	191,501,204.980 (1,061,261,378)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	690,000.000	700,485.930	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,230,000.000	1,240,092.760	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	202,373.200	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	200,000.000	185,420.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	820,000.000	867,955.240	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	549,429.400	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	620,000.000	666,734.980	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	440,000.000	463,307.680	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	680,000.000	725,395.440	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	170,000.000	164,691.070	
	AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	658,807.500	
	AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	815,541.600	
	AUSTRIA 09/20/22	240,000.000	241,995.500	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	689,661.440	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	490,000.000	610,754.130	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	202,575.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	581,399.640	

AUSTRIA 1.75 10/20/23	870,000.000	918,595.590	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	350,000.000	603,251.250	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	622,224.860	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	470,000.000	757,784.050	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	781,329.740	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	445,859.400	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,436,994.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	741,694.310	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	943,601.200	
BELGIUM 0.0 10/22/27	500,000.000	512,484.900	
BELGIUM 0.0 10/22/31	570,000.000	568,959.750	
BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	817,200.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	673,299.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	320,000.000	313,107.840	
BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	550,082.910	
BELGIUM 0.65 06/22/71	330,000.000	284,146.660	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,203,205.020	
BELGIUM 0.8 06/22/27	840,000.000	902,092.800	
BELGIUM 0.8 06/22/28	930,000.000	1,005,144.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,030,000.000	1,122,994.580	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,600,000.000	1,721,102.400	
BELGIUM 1.0 06/22/31	930,000.000	1,028,412.600	
BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	808,633.200	
BELGIUM 1.45 06/22/37	530,000.000	620,372.950	
BELGIUM 1.6 06/22/47	570,000.000	686,184.240	
BELGIUM 1.7 06/22/50	490,000.000	603,917.160	
BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	685,159.200	
BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	606,942.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	877,794.050	
BELGIUM 2.25 06/22/57	350,000.000	498,737.050	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,151,930.430	
BELGIUM 3.0 06/22/34	590,000.000	804,705.720	
BELGIUM 3.75 06/22/45	650,000.000	1,097,422.420	
BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	758,741.740	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,060,000.000	1,804,320.340	
BELGIUM 4.25 09/28/22	690,000.000	731,556.280	
BELGIUM 4.5 03/28/26	430,000.000	534,145.140	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,804,202.880	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,743,235.400	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,430,000.000	1,474,158.400	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,282,731.250	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,800,000.000	1,852,218.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	300,000.000	309,066.000	
BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,569,986.880	
BUNDESOBL 04/14/23	1,030,000.000	1,042,864.700	
BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,412,217.800	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,301,107.200	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,156,229.560	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,751,600.500	

DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,660,000.000	1,714,132.600	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,700,000.000	1,723,256.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	700,000.000	703,528.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	2,069,800.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	520,400.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	500,000.000	514,860.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,720,000.000	1,620,054.240	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	400,000.000	380,888.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,200,000.000	1,242,192.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	2,055,177.600	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,890,000.000	1,997,720.550	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,519,977.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,060,000.000	2,150,681.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,908,464.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,930,000.000	2,065,872.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,800,000.000	1,920,349.800	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,734,878.880	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,610,000.000	1,669,070.900	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,412,232.700	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,894,147.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,720,000.000	2,212,657.880	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,420,000.000	1,470,048.610	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,717,524.930	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,410,000.000	1,500,048.240	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	850,000.000	871,583.200	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,750,000.000	2,928,501.120	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,576,943.060	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,930,000.000	3,098,513.090	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,760,000.000	2,743,382.400	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,190,000.000	3,485,073.780	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,100,000.000	1,848,660.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,730,000.000	2,850,069.470	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,140,000.000	2,033,657.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	828,246.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,420,000.000	2,360,025.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	840,000.000	1,611,019.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	1,954,922.000	

DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,640,240.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	986,932.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,126,670.600	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,018,864.200	
FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	183,822.120	
FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	172,411.960	
FINLAND 0.125 04/15/36	210,000.000	208,143.600	
FINLAND 0.125 04/15/52	210,000.000	189,211.260	
FINLAND 0.125 09/15/31	140,000.000	142,578.660	
FINLAND 0.25 09/15/40	170,000.000	168,439.060	
FINLAND 0.5 04/15/26	430,000.000	452,016.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	529,624.500	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	254,922.000	
FINLAND 0.5 09/15/29	570,000.000	605,860.980	
FINLAND 0.75 04/15/31	250,000.000	271,615.250	
FINLAND 0.875 09/15/25	390,000.000	414,234.600	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	233,467.480	
FINLAND 1.125 04/15/34	290,000.000	329,053.140	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	349,014.680	
FINLAND 1.5 04/15/23	470,000.000	488,127.900	
FINLAND 1.625 09/15/22	240,000.000	246,488.160	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	301,089.040	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	517,123.950	
FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	465,266.300	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	510,411.720	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,199,414.400	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	1,100,000.000	1,111,374.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	500,000.000	507,966.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,300,000.000	2,352,308.900	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	1,400,000.000	1,430,002.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,150,000.000	2,175,182.950	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,700,000.000	2,710,292.400	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	1,130,000.000	1,123,592.900	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	1,750,000.000	1,815,254.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	1,920,000.000	1,999,219.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,070,000.000	3,218,500.500	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,620,000.000	2,763,900.880	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,100,000.000	1,094,540.700	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	600,000.000	479,479.200	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	740,000.000	720,066.620	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,750,000.000	2,949,666.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,730,000.000	1,688,211.850	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,240,000.000	3,480,479.280	
FRANCE OAT 03/25/23	2,700,000.000	2,729,640.600	
FRANCE OAT 03/25/24	2,520,000.000	2,562,625.800	
FRANCE OAT 03/25/25	2,470,000.000	2,521,455.040	

FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,350,000.000	2,543,640.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,220,000.000	2,369,638.430	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,340,000.000	2,646,858.240	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,190,000.000	2,484,774.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,090,000.000	3,552,647.770	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,200,000.000	2,605,372.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,130,000.000	3,270,793.660	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	820,000.000	1,059,210.400	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,690,000.000	2,077,652.200	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,680,000.000	2,894,793.960	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,690,000.000	2,212,977.260	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,144,924.100	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,030,000.000	2,106,210.260	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,940,000.000	3,627,339.660	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,280,000.000	3,932,090.240	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,600,000.000	2,529,536.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,820,000.000	3,366,375.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,060,000.000	2,041,136.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,090,000.000	2,197,918.940	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,439,646.360	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,730,000.000	3,039,106.160	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,310,000.000	4,053,541.800	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,050,000.000	3,316,444.900	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,686,139.440	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,100,000.000	3,452,673.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,311,497.000	
IRISH 0.0 10/18/31	360,000.000	356,572.440	
IRISH 0.2 05/15/27	510,000.000	526,608.660	
IRISH 0.2 10/18/30	450,000.000	458,511.300	
IRISH 0.4 05/15/35	240,000.000	242,806.800	
IRISH 0.55 04/22/41	230,000.000	229,154.060	
IRISH 0.9 05/15/28	600,000.000	647,803.200	
IRISH 1.0 05/15/26	640,000.000	685,283.200	
IRISH 1.1 05/15/29	520,000.000	571,096.650	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	385,031.300	
IRISH 1.35 03/18/31	470,000.000	531,784.320	
IRISH 1.5 05/15/50	420,000.000	497,380.800	
IRISH 1.7 05/15/37	390,000.000	468,000.390	
IRISH 10/18/22	30,000.000	30,234.090	
IRISH 2.0 02/18/45	560,000.000	728,644.000	
IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	768,552.120	
IRISH 3.4 03/18/24	560,000.000	620,155.200	
IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	613,563.610	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	975,728.000	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	1,006,600.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,000,000.000	1,006,000.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	580,000.000	575,650.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,013,600.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,080,000.000	1,098,725.040	



ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,400,000.000	1,430,310.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	500,000.000	503,100.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	509,550.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,210,000.000	1,191,699.760	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	1,001,765.800	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	700,000.000	725,550.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,200,000.000	2,237,774.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	994,014.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	940,341.840	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	900,000.000	865,260.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,093,700.500	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,201,005.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,200,000.000	1,249,320.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,429,987.500	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,510,000.000	1,606,988.810	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	1,060,902.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,340,000.000	1,419,583.130	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	900,000.000	919,988.100	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,096,459.310	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	530,000.000	522,792.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,795,243.060	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,181,400.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,840,000.000	1,997,263.320	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,609,739.760	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	800,000.000	788,973.600	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,269,928.800	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	600,000.000	634,320.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	857,871.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	969,120.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,541,194.470	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,055,711.140	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	740,000.000	819,996.960	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,580,000.000	1,738,711.000	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	500,000.000	498,750.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,120,000.000	1,249,360.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,171,470.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,140,000.000	1,334,507.940	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	970,000.000	1,127,140.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	987,634.890	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,250,000.000	1,387,321.870	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,275,802.860	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	820,000.000	997,038.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	709,652.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,700,000.000	1,992,542.800	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,177,068.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,591,071.020	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,230,000.000	1,571,286.870	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,316,795.040	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,010,000.000	1,298,695.370	

ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,407,965.160	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,540,000.000	1,919,871.800	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,010,000.000	1,135,757.320	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	1,094,385.260	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,311,218.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,990,000.000	3,365,850.770	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,968,388.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,524,161.800	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,100,830.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,390,000.000	1,813,876.600	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,570,985.810	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,125,220.980	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,388,435.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,110,178.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,490,000.000	2,388,768.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,750,000.000	2,423,925.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,227,912.500	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,111,592.470	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,963,904.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,458,977.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,484,341.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,487,700.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,445,374.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	920,000.000	946,659.010	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	539,966.350	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	510,000.000	467,844.930	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	650,000.000	665,278.250	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	540,000.000	549,473.220	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,420,000.000	1,471,617.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	827,696.430	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	590,000.000	631,574.940	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,250,000.000	1,318,937.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,020,000.000	1,098,420.660	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	980,000.000	1,062,387.620	
NETHERLANDS 01/15/24	2,330,000.000	2,372,002.910	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	887,346.600	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	980,000.000	1,009,325.520	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	780,000.000	1,019,005.260	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	980,000.000	1,606,828.580	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	390,000.000	416,571.480	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,160,000.000	2,015,203.040	

NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,080,000.000	1,748,736.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,186,345.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,420,160.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	800,000.000	810,490.400	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,050,000.000	1,052,310.000	
SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	1,000,226.700	
SPAIN 0.0 05/31/24	860,000.000	870,687.390	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,190,000.000	1,160,975.900	
SPAIN 0.25 07/30/24	940,000.000	959,867.930	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,420,000.000	1,444,847.160	
SPAIN 0.45 10/31/22	840,000.000	851,431.560	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,850,000.000	1,894,335.250	
SPAIN 0.5 10/31/31	500,000.000	503,892.500	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,180,000.000	1,222,621.600	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,266,300.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	600,000.000	596,698.800	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,070,000.000	985,012.040	
SPAIN 1.2 10/31/40	970,000.000	996,395.640	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,370,000.000	1,490,834.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,550,000.000	1,677,572.750	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,440,000.000	1,578,967.200	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,659,339.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,293,000.930	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,360,000.000	1,492,776.800	
SPAIN 1.45 10/31/71	300,000.000	270,921.900	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,240,000.000	1,361,334.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,561,711.470	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,290,000.000	1,486,004.390	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,407,162.540	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,683,343.500	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,380,000.000	1,530,130.200	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,496,060.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,145,792.620	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,704,184.320	
SPAIN 2.9 10/31/46	960,000.000	1,315,293.020	
SPAIN 3.45 07/30/66	920,000.000	1,444,564.680	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,422,915.620	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,350,000.000	2,030,759.100	
SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,236,437.980	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,652,291.240	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,270,000.000	2,120,277.310	
SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,283,574.910	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,973,205.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	1,180,000.000	1,621,556.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	910,000.000	1,663,063.220	
SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,595,470.620	
SPAIN 5.75 07/30/32	1,520,000.000	2,394,243.200	
SPAIN 5.9 07/30/26	1,370,000.000	1,799,813.110	
SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,291,071.100	

	ユーロ 小計	385,020,000.000 (50,368,316,400)	450,174,618.440 (58,891,843,584)	
国債証券	合計	131,855,170,331.800 (131,855,170,332)	146,028,231,716 (146,028,231,716)	
合計			146,028,231,716 (146,028,231,716)	

(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 217銘柄	45.11	45.53
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	6.38	6.44
イスラエル・シェケル	国債証券 11銘柄	0.46	0.46
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	2.03	2.05
カナダ・ドル	国債証券 29銘柄	1.93	1.95
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	0.43	0.44
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.30	0.30
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.49	0.49
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.23	0.23
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.61	0.61
マレーシア・リングギット	国債証券 12銘柄	0.43	0.44
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.72	0.73
ユーロ	国債証券 337銘柄	39.95	40.33

(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）

2021年7月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,663,193,916
コール・ローン	555,414,417
株式	560,116,074,613
投資信託受益証券	1,052,095,927
投資証券	12,170,787,413
派生商品評価勘定	144,262,815
未収入金	77,753,865
未収配当金	408,719,032
差入委託証拠金	3,862,122,633
流動資産合計	582,050,424,631
資産合計	
582,050,424,631	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,997,252
未払金	21,888,732
未払解約金	328,194,000
流動負債合計	365,079,984
負債合計	
365,079,984	
純資産の部	
元本等	
元本	106,771,439,533
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	474,913,905,114
元本等合計	581,685,344,647
純資産合計	
581,685,344,647	
負債純資産合計	
582,050,424,631	

## 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1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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	2021年7月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	96,044,539,510円
同期中追加設定元本額	33,205,284,128円
同期中一部解約元本額	22,478,384,105円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,642,621,984円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,917,968円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,358,643円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,898,037円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,446,418円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	14,742,203円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,076,354円
たわらノーロード 先進国株式	23,515,364,107円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	266,243,996円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,504,089,471円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	468,314,130円
たわらノーロード バランス(堅実型)	52,633,395円
たわらノーロード バランス(標準型)	423,051,505円
たわらノーロード バランス(積極型)	512,407,045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)	1,304,396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)	132,430,515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)	365,384,456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)	245,230,203円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	383,400,121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)	572,470円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	6,752,427円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,498,180円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,873,530円
たわらノーロード 全世界株式	119,044,205円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	48,913,966,711円
One DC 先進国株式インデックスファンド	1,266,817,556円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	155,901,022円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	849,633,152円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,040,670,055円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	97,521,957円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	303,097,115円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	272,336,437円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	21,200,412円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	668,457,892円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	131,955,592円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	183,554,879円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,716,522円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	295,063,878円
投資のソムリエ	6,272,856,818円
クルーズコントロール	146,215,612円
投資のソムリエ<DC年金>	328,706,467円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	181,643,617円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	120,557,877円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,089,845円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,828,371円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	163,938,516円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,657,515,116円
ワールドアセットバランス(基本コース)	256,115,887円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	821,968,793円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	21,367,464円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	10,244,039円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,551,710円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	41,406,989円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	39,286,878円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	693,868,629円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	153,922,765円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	16,161,718円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	7,839,488円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,687,155円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	9,693,367円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	72,023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)	2,575,078円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	3,022,645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)	6,873,573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)	1,479,914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)	2,392,306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)	3,601,644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)	174,194,922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)	622,216,988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)	59,577,062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)	1,344,175,761円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,192,479,550円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,118,768,512円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	164,992,159円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	9,196,101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)	4,106,147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)	36,627,454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)	63,456,042円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,483,313円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,769,308円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,222,150円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	780,891円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,280,113円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,620,811円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	240,111,298円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	347,601,401円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,133,044,621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)	170,104,489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)	60,452,544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)	389,075,438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)	16,587,221円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,101,694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)	161,720,334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)	13,657,185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)	51,207,166円



D I A M世界アセットバランスファンド3 V A ( 適格機関投資家限定 )	81,342,175円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A ( 適格機関投資家限定 )	169,451,993円
計	106,771,439,533円
2. 受益権の総数	106,771,439,533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1月13日 至 2021年7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	46,282,809,266	
投資信託受益証券	81,957,035	
投資証券	1,816,916,829	
合計	48,181,683,130	

（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（2021年2月16日から2021年7月12日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	11,974,352	-	12,035,532	61,180
ユーロ	11,974,352	-	12,035,532	61,180
買建	401,113,019	-	401,543,035	430,016
アメリカ・ドル	311,982,622	-	312,215,587	232,965
イギリス・ポンド	8,032,415	-	8,114,761	82,346
オーストラリア・ドル	12,128,174	-	12,190,694	62,520
カナダ・ドル	8,791,688	-	8,843,919	52,231
ユーロ	60,178,120	-	60,178,074	46
合計	413,087,371	-	413,578,567	368,836

## （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	2021年7月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	8,444,821,380	-	8,573,718,107	128,896,727
合計	8,444,821,380	-	8,573,718,107	128,896,727

(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)

2021年7月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.4479円 (54,479円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年7月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	40,745	3,719.340	151,544,508.300	
	ABBOTT LABORATORIES	169,013	119.740	20,237,616.620	
	AES CORP	65,452	25.730	1,684,079.960	
	ABIOMED INC	3,987	324.770	1,294,857.990	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	85,020	141.520	12,032,030.400	
	ADVANCED MICRO DEVICES	115,676	90.900	10,514,948.400	
	ADOBE INC	45,638	604.500	27,588,171.000	
	CHUBB LTD	43,030	162.730	7,002,271.900	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,624	291.670	6,015,402.080	
	ALLEGHANY CORP	1,278	673.670	860,950.260	
	ALLSTATE CORP	28,336	133.470	3,782,005.920	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	66,301	224.340	14,873,966.340	
	AMGEN INC	55,002	245.200	13,486,490.400	
	HESS CORP	27,192	84.010	2,284,399.920	
	AMERICAN EXPRESS CO	65,687	171.940	11,294,222.780	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	46,414	85.390	3,963,291.460	
	AFLAC INC	61,310	53.350	3,270,888.500	

AMERICAN INTL GROUP	80,846	46.870	3,789,252.020	
AMERCO	929	584.000	542,536.000	
ANALOG DEVICES	34,575	166.270	5,748,785.250	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,674	184.200	3,808,150.800	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	67,283	70.060	4,713,846.980	
VALERO ENERGY CORP	39,592	72.300	2,862,501.600	
ANSYS INC	8,258	353.760	2,921,350.080	
APPLE INC	1,597,566	145.110	231,822,802.260	
APPLIED MATERIALS INC	87,368	134.900	11,785,943.200	
ALBEMARLE CORP	10,736	175.510	1,884,275.360	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,757	60.320	3,182,302.240	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,236	83.650	939,891.400	
AMEREN CORP	25,054	81.920	2,052,423.680	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	113.380	754,090.380	
AUTOLIV INC	7,570	96.040	727,022.800	
AUTODESK INC	21,119	295.380	6,238,130.220	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	40,849	203.720	8,321,758.280	
AUTOZONE INC	2,212	1,564.530	3,460,740.360	
AVERY DENNISON CORP	7,627	210.350	1,604,339.450	
BALL CORP	30,947	84.790	2,623,996.130	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	130,659	280.490	36,648,542.910	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	80,600	49.930	4,024,358.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,518	80.430	3,821,872.740	
BECTON DICKINSON & CO	27,192	249.800	6,792,561.600	
AMETEK INC	21,813	135.470	2,955,007.110	
VERIZON COMM INC	392,604	56.070	22,013,306.280	
WR BERKLEY CORP	12,511	75.620	946,081.820	
BEST BUY CO INC	21,291	110.860	2,360,320.260	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,002	675.170	1,351,690.340	
YUM! BRANDS INC	29,043	118.580	3,443,918.940	
FIRSTENERGY CORP	53,250	37.530	1,998,472.500	
BOEING CO	53,000	239.590	12,698,270.000	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	88.450	994,001.100	
BORGWARNER INC	21,938	47.800	1,048,636.400	
BOSTON BEER COMPANY INC- CL A	860	973.580	837,278.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	132,377	43.590	5,770,313.430	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	93.170	1,091,859.230	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,777	170.370	1,836,077.490	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,263	1,435.410	3,248,332.830	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	213,989	67.160	14,371,501.240	
ONEOK INC	43,019	57.520	2,474,452.880	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	123.430	918,812.920	
UNITED RENTALS INC	7,145	317.480	2,268,394.600	
SEMPRA ENERGY	30,392	132.860	4,037,881.120	
FEDEX CORP	24,119	296.400	7,148,871.600	
VERISIGN INC	10,001	233.030	2,330,533.030	
AMPHENOL CORP	56,395	70.310	3,965,132.450	
BROWN-FORMAN CORP	28,552	74.120	2,116,274.240	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.560	637,212.160	
CSX CORP	219,832	31.830	6,997,252.560	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	45.640	928,043.760	
CONSTELLATION BRANDS INC	15,878	227.690	3,615,261.820	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	57.180	1,658,505.900	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	75,800	24.260	1,838,908.000	
CATERPILLAR INC	52,092	217.420	11,325,842.640	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	123.800	1,221,287.000	
CITRIX SYSTEMS INC	11,589	116.170	1,346,294.130	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	13.510	1,245,459.880	
CERNER CORP	29,663	79.570	2,360,284.910	
JPMORGAN CHASE & CO	290,618	155.770	45,269,565.860	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,345	86.980	2,117,528.100	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,567	118.870	1,731,579.290	
CINTAS CORP	9,113	388.320	3,538,760.160	
CISCO SYSTEMS INC	401,554	53.740	21,579,511.960	
CLOROX COMPANY	12,417	180.880	2,245,986.960	
COCA-COLA CO/THE	389,600	54.460	21,217,616.000	
COPART INC	20,203	138.490	2,797,913.470	
COGNEX CORP	16,685	86.580	1,444,587.300	
COLGATE-PALMOLIVE CO	74,700	82.430	6,157,521.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	26,524	142.480	3,779,139.520	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	257.250	1,338,471.750	
NRG ENERGY, INC.	21,039	41.970	883,006.830	
COMCAST CORP-CL A	435,455	58.030	25,269,453.650	
CONAGRA BRANDS INC	48,557	36.120	1,753,878.840	
CONSOLIDATED EDISON INC	32,567	73.300	2,387,161.100	
CMS ENERGY CORP	28,837	60.310	1,739,159.470	
COOPER COS INC	4,682	411.230	1,925,378.860	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	53.180	878,161.340	
CORNING INC	74,726	41.030	3,066,007.780	
SEALED AIR CORP	13,870	58.400	810,008.000	
HEICO CORP-CL A	7,477	130.220	973,654.940	

CUMMINS INC	13,999	242.700	3,397,557.300	
DR HORTON INC	33,099	89.570	2,964,677.430	
DANAHER CORP	61,194	277.470	16,979,499.180	
MOODY'S CORP	15,692	375.590	5,893,758.280	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,941	69.140	3,522,060.740	
TARGET CORP	47,793	248.580	11,880,383.940	
DEERE & CO	28,474	349.480	9,951,093.520	
MORGAN STANLEY	134,696	90.330	12,167,089.680	
REPUBLIC SERVICES INC	21,249	112.670	2,394,124.830	
COSTAR GROUP INC	37,150	86.280	3,205,302.000	
THE WALT DISNEY CO	173,115	177.040	30,648,279.600	
DOLLAR TREE INC	21,528	99.510	2,142,251.280	
DOVER CORP	13,837	153.460	2,123,426.020	
OMNICOM GROUP	21,323	80.050	1,706,906.150	
DTE ENERGY CO	18,373	115.600	2,123,918.800	
DUKE ENERGY CORP	73,337	100.660	7,382,102.420	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,936	148.580	1,922,030.880	
EBAY INC	65,353	69.460	4,539,419.380	
BANK OF AMERICA CORP	740,316	40.040	29,642,252.640	
CITIGROUP INC	198,704	68.450	13,601,288.800	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,081	114.950	1,503,660.950	
EATON CORP PLC	37,269	153.560	5,723,027.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,386	138.500	3,654,461.000	
DISH NETWORK CORP	21,420	41.500	888,930.000	
ECOLAB INC	24,683	212.760	5,251,555.080	
PERKINELMER INC	11,099	153.960	1,708,802.040	
ELECTRONIC ARTS INC	26,968	140.990	3,802,218.320	
SALESFORCE.COM INC	87,533	245.060	21,450,836.980	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	188.220	422,177.460	
EMERSON ELECTRIC CO	56,135	97.610	5,479,337.350	
ATMOS ENERGY CORP	11,503	98.530	1,133,390.590	
ENTERGY CORP	19,089	102.920	1,964,639.880	
EOG RESOURCES INC	55,339	82.590	4,570,448.010	
EQUIFAX INC	11,797	248.540	2,932,026.380	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	21,932	317.870	6,971,524.840	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	15,999	128.400	2,054,271.600	
EXXON MOBIL CORP	404,291	61.230	24,754,737.930	
FMC CORP	11,416	107.660	1,229,046.560	
NEXTERA ENERGY INC	186,767	74.990	14,005,657.330	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,844	343.200	1,319,260.800	
FAIR ISAAC CORP	2,810	524.050	1,472,580.500	
ASSURANT INC	5,523	156.990	867,055.770	
FASTENAL CO	54,270	53.840	2,921,896.800	
FIFTH THIRD BANCORP	68,183	38.080	2,596,408.640	
M&T BANK CORP	12,653	142.330	1,800,901.490	
FISERV INC	56,229	108.940	6,125,587.260	
FORD MOTOR CO	366,733	14.480	5,310,293.840	

FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	32.150	858,855.100	
FREEMPORT-MCMORAN INC	136,911	36.500	4,997,251.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,922	140.500	2,518,041.000	
DENTSPLY SIRONA INC	19,366	62.420	1,208,825.720	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,460	190.220	4,462,561.200	
GENERAL MILLS INC	58,257	59.700	3,477,942.900	
GENUINE PARTS CO	14,520	129.520	1,880,630.400	
GILEAD SCIENCES INC	120,161	68.220	8,197,383.420	
GARTNER INC	8,725	256.870	2,241,190.750	
MCKESSON CORP	15,457	189.100	2,922,918.700	
NVIDIA CORP	58,950	802.010	47,278,489.500	
GENERAL ELECTRIC CO	837,394	13.160	11,020,105.040	
WW GRAINGER INC	4,182	456.830	1,910,463.060	
HALLIBURTON CO	84,523	22.380	1,891,624.740	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,030	90.240	3,341,587.200	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,012	371.760	12,272,541.120	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,744	223.990	4,422,458.560	
HASBRO INC	11,383	97.980	1,115,306.340	
HENRY SCHEIN INC	14,358	76.810	1,102,837.980	
HEICO CORP	3,623	142.200	515,190.600	
HERSHEY FOODS CORP	13,964	176.750	2,468,137.000	
HP INC	119,936	30.040	3,602,877.440	
F5 NETWORKS INC	5,529	190.860	1,055,264.940	
CROWN HOLDINGS INC NPR	13,523	105.570	1,427,623.110	
JUNIPER NETWORKS INC	34,151	27.620	943,250.620	
HOLOGIC INC	24,690	69.310	1,711,263.900	
HOME DEPOT INC	102,578	322.090	33,039,348.020	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,271	83.620	1,527,821.020	
HORMEL FOODS CORP	26,254	47.440	1,245,489.760	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,065	25.470	1,249,685.550	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	342.150	1,170,495.150	
HUMANA INC	12,034	455.650	5,483,292.100	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	165.780	1,250,644.320	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	135,857	14.270	1,938,679.390	
BIOGEN INC	14,278	358.160	5,113,808.480	
IDEX CORP	7,369	224.270	1,652,645.630	
ILLINOIS TOOL WORKS	30,326	227.380	6,895,525.880	
INTUIT INC	26,099	503.930	13,152,069.070	
IDEXX LABORATORIES INC	8,039	667.030	5,362,254.170	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	22,329	190.320	4,249,655.280	
INTEL CORP	386,800	55.990	21,656,932.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	24,095	147.700	3,558,831.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	35,936	62.240	2,236,656.640	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	33.080	1,168,286.360	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,946	134.650	1,743,178.900	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,874	167.380	1,150,570.120	
INCYTE CORP	18,028	82.040	1,479,017.120	
JOHNSON & JOHNSON	250,084	169.750	42,451,759.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,801	61.580	2,143,045.580	
KLA CORPORATION	14,434	308.760	4,456,641.840	
DEVON ENERGY CORP	62,146	28.650	1,780,482.900	
KELLOGG CO	25,753	64.280	1,655,402.840	
KEYCORP	92,367	20.170	1,863,042.390	
KIMBERLY-CLARK CORP	31,829	135.020	4,297,551.580	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,550	901.310	13,114,060.500	
KROGER CO	67,295	38.270	2,575,379.650	
LAM RESEARCH CORP	13,622	612.850	8,348,242.700	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,354	426.790	1,858,243.660	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	138.630	1,169,759.940	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,625	117.900	1,842,187.500	
PLUG POWER INC	48,997	29.390	1,440,021.830	
LENNAR CORP	27,033	98.930	2,674,374.690	
ELI LILLY & CO	77,664	234.990	18,250,263.360	
L BRANDS INC	21,742	73.500	1,598,037.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	62.010	1,121,760.900	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	68,654	213.920	14,686,463.680	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,630	150.030	4,295,358.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,054	383.110	9,215,327.940	
LOEWS CORP	22,394	54.710	1,225,175.740	
LOWE'S COS INC	69,807	195.330	13,635,401.310	
DOMINION ENERGY INC	75,079	75.550	5,672,218.450	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,356	41.600	1,512,409.600	
MCCORMICK & CO INC	24,703	87.100	2,151,631.300	
MCDONALD'S CORPORATION	71,078	235.680	16,751,663.040	
S&P GLOBAL INC	23,018	414.680	9,545,104.240	
EVEREST RE GROUP LTD	4,101	247.860	1,016,473.860	
MARKEL CORPORATION	1,367	1,238.290	1,692,742.430	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	60,035	107.510	6,454,362.850	
MARSH & MCLENNAN COS	48,601	142.600	6,930,502.600	
MASCO CORP	23,151	58.450	1,353,175.950	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,781	357.920	2,069,135.520	
METLIFE INC	70,118	58.860	4,127,145.480	



MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,532	100.030	2,553,965.960	
MEDTRONIC PLC	128,205	128.170	16,432,034.850	
ACTIVISION BLIZZARD INC	74,057	92.380	6,841,385.660	
CVS HEALTH CORP	125,137	81.320	10,176,140.840	
MERCK & CO. INC.	240,861	77.990	18,784,749.390	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	40,848	37.750	1,542,012.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,422	281.030	2,647,864.660	
MICROSOFT CORP	681,800	277.940	189,499,492.000	
MICRON TECH INC	107,206	78.740	8,441,400.440	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,030	144.020	3,748,840.600	
3M CO	55,129	201.000	11,080,929.000	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	198.950	1,186,338.850	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	4,764	384.890	1,833,615.960	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,003	224.520	3,592,993.560	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,346	273.950	2,286,386.700	
ILLUMINA INC	13,966	476.800	6,658,988.800	
XCEL ENERGY INC	50,530	67.670	3,419,365.100	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	99.030	961,878.390	
NETAPP INC	21,903	82.570	1,808,530.710	
NEWELL BRANDS INC	33,317	27.030	900,558.510	
NEWMONT CORP	77,126	63.980	4,934,521.480	
NOVAVAX INC	6,444	188.590	1,215,273.960	
NVR INC	352	5,060.840	1,781,415.680	
NIKE INC-CL B	121,359	161.000	19,538,799.000	
NORDSON CORP	4,644	221.300	1,027,717.200	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,266	263.640	6,397,488.240	
EVERSOURCE ENERGY	32,548	82.630	2,689,441.240	
NISOURCE INC	40,775	25.140	1,025,083.500	
NORTHERN TRUST CORP	18,957	115.550	2,190,481.350	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,764	371.820	5,489,550.480	
WELLS FARGO & CO	394,303	43.910	17,313,844.730	
NUCOR CORP	28,381	97.170	2,757,781.770	
CHENIERE ENERGY INC	22,775	88.010	2,004,427.750	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	44,408	160.550	7,129,704.400	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	86,193	30.240	2,606,476.320	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,119	260.580	2,376,229.020	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,907	591.650	4,086,526.550	
ORACLE CORP	182,094	87.760	15,980,569.440	
PACCAR INC	32,894	87.500	2,878,225.000	
PTC INC	11,092	145.140	1,609,892.880	
EXELON CORP	90,816	44.910	4,078,546.560	

PARKER HANNIFIN CORP	12,149	311.570	3,785,263.930	
PAYCHEX INC	29,778	111.900	3,332,158.200	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,020	627.190	4,402,873.800	
PPL CORPORATION	75,032	28.440	2,133,910.080	
PEPSICO INC	131,174	149.480	19,607,889.520	
PENTAIR PLC	16,339	69.300	1,132,292.700	
PFIZER INC	530,884	39.610	21,028,315.240	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24,458	47.940	1,172,516.520	
CONOCOPHILLIPS	130,401	60.130	7,841,012.130	
PG&E CORP	140,021	10.370	1,452,017.770	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,533	158.000	3,086,214.000	
ALTRIA GROUP INC	177,548	47.400	8,415,775.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,734	189.670	7,726,017.780	
BROWN & BROWN INC	24,295	52.950	1,286,420.250	
GARMIN LTD	14,305	148.810	2,128,727.050	
PPG INDUSTRIES INC	22,227	171.410	3,809,930.070	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	207.410	695,445.730	
COSTCO WHOLESALE CORP	42,184	412.370	17,395,416.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	22,009	205.200	4,516,246.800	
QUEST DIAGNOSTICS	11,926	135.040	1,610,487.040	
PROCTER & GAMBLE CO	234,237	137.030	32,097,496.110	
PROGRESSIVE CORP	54,685	99.630	5,448,266.550	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	47,460	60.490	2,870,855.400	
PULTE GROUP INC	25,385	53.230	1,351,243.550	
GLOBAL PAYMENTS INC	27,589	190.370	5,252,117.930	
QUALCOMM INC	108,151	141.430	15,295,795.930	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,126	132.020	1,600,874.520	
EXACT SCIENCES CORP	16,027	119.700	1,918,431.900	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,638	151.040	700,523.520	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,840	580.400	5,711,136.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	112.820	687,863.540	
RESMED INC	14,065	247.680	3,483,619.200	
US BANCORP	136,888	56.970	7,798,509.360	
SEAGEN INC	12,602	148.500	1,871,397.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,809	38.500	1,494,146.500	
ROSS STORES INC	33,574	124.770	4,189,027.980	
ROLLINS INC	18,567	35.390	657,086.130	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,805	481.180	4,717,969.900	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,708	291.200	3,118,169.600	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,882	82.330	1,883,875.060	
RPM INTERNATIONAL INC	12,897	90.520	1,167,436.440	

ACCENTURE PLC-CL A	60,290	312.620	18,847,859.800	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	134,296	63.020	8,463,333.920	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,442	228.210	2,839,388.820	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,554	153.330	3,611,534.820	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	59,564	144.420	8,602,232.880	
BOOKING HOLDINGS INC	3,925	2,194.990	8,615,335.750	
SCHLUMBERGER LTD	132,163	31.190	4,122,163.970	
SCHWAB (CHARLES) CORP	138,073	70.550	9,741,050.150	
POOL CORP	3,925	476.240	1,869,242.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,585	159.310	3,120,086.350	
BUNGE LTD	13,581	77.450	1,051,848.450	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	62.120	661,764.360	
ANTHEM INC	23,361	388.610	9,078,318.210	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,836	115.130	1,592,938.680	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,038	61.990	1,552,105.620	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,473	276.220	6,759,932.060	
CENTENE CORP	56,124	73.510	4,125,675.240	
SVB FINANCIAL GROUP	4,933	575.240	2,837,658.920	
SMITH (A.O.) CORP	14,015	70.750	991,561.250	
SNAP-ON INC	5,408	227.650	1,231,131.200	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,586	100.580	3,780,399.880	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	213.470	1,329,064.220	
EDISON INTERNATIONAL	35,704	58.280	2,080,829.120	
SOUTHERN CO	101,048	61.470	6,211,420.560	
TRUIST FINANCIAL CORP	125,807	55.210	6,945,804.470	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	52.840	698,544.800	
AT&T INC	678,847	28.450	19,313,197.150	
CHEVRON CORP	183,703	104.070	19,117,971.210	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,115	208.530	3,151,930.950	
STATE STREET CORP	32,482	84.110	2,732,061.020	
STARBUCKS CORP	112,621	117.470	13,229,588.870	
STEEL DYNAMICS INC	20,423	61.500	1,256,014.500	
STRYKER CORP	32,381	264.430	8,562,507.830	
NETFLIX INC	42,213	535.980	22,625,323.740	
NORTONLIFELOCK INC	55,388	27.660	1,532,032.080	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	49.780	790,854.860	
SYNOPSIS INC	14,414	280.750	4,046,730.500	
SYSCO CORP	48,959	76.140	3,727,738.260	
INTUITIVE SURGICAL INC	11,275	950.780	10,720,044.500	
TELEFLEX INC	4,634	422.820	1,959,347.880	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	9.300	983,540.100	
TERADYNE INC	15,807	125.700	1,986,939.900	
TEXAS INSTRUMENTS INC	87,452	190.270	16,639,492.040	
TEXTRON INC	22,278	67.700	1,508,220.600	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,572	517.260	19,434,492.720	
GLOBE LIFE INC	10,611	94.460	1,002,315.060	
DAVITA INC	6,497	122.090	793,218.730	
TRACTOR SUPPLY CO	11,488	186.910	2,147,222.080	
BIO-TECHNE CORP	3,634	465.390	1,691,227.260	
TRIMBLE INC	24,682	83.260	2,055,023.320	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,014	478.840	1,922,063.760	
TYSON FOODS INC	28,566	73.550	2,101,029.300	
UGI CORP	19,377	46.540	901,805.580	
UNION PACIFIC CORP	63,915	221.690	14,169,316.350	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	145,632	86.380	12,579,692.160	
UNITEDHEALTH GROUP INC	90,263	412.110	37,198,284.930	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	153.950	1,191,111.150	
VF CORP	31,762	83.070	2,638,469.340	
VIACOMCBS INC	55,074	42.770	2,355,514.980	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,192	198.160	4,992,046.720	
VULCAN MATERIALS CO	12,232	174.930	2,139,743.760	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	70,887	47.410	3,360,752.670	
WALMART INC	148,063	140.300	20,773,238.900	
WASTE MANAGEMENT INC	39,623	143.040	5,667,673.920	
WATERS CORP	5,847	369.400	2,159,881.800	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,128	374.190	2,667,226.320	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,306	130.850	1,348,540.100	
VAIL RESORTS INC	3,590	325.630	1,169,011.700	
WESTERN DIGITAL CORP	29,830	70.170	2,093,171.100	
WABTEC CORP	18,377	82.850	1,522,534.450	
WHIRLPOOL CORP	5,587	225.020	1,257,186.740	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,115	189.570	2,865,350.550	
WYNN RESORTS LTD	9,809	113.870	1,116,950.830	
NASDAQ INC	11,126	175.770	1,955,617.020	
CME GROUP INC	34,375	209.620	7,205,687.500	
WILLIAMS COS INC	117,180	26.700	3,128,706.000	
LKQ CORP	28,725	50.970	1,464,113.250	
ALLIANT ENERGY CORP	22,453	56.760	1,274,432.280	
WEC ENERGY GROUP INC	29,256	91.840	2,686,871.040	
CARMAX INC	16,043	134.840	2,163,238.120	
XILINX INC	23,712	135.590	3,215,110.080	
TJX COMPANIES INC	115,318	68.360	7,883,138.480	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,193	547.730	2,844,361.890	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.740	515,238.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	63.930	1,316,958.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,581	176.740	2,046,825.940	
CBRE GROUP INC	31,654	85.830	2,716,862.820	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	26.490	337,270.680	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,214	19.870	1,931,642.180	
DOMINO'S PIZZA INC	3,716	477.560	1,774,612.960	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,275	382.600	1,635,615.000	
T-MOBILE US INC	59,375	146.010	8,669,343.750	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,060	51.330	1,696,969.800	
MOSAIC CO/THE	32,592	31.790	1,036,099.680	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,402	460.770	1,567,539.540	
CELANESE CORP	11,626	153.530	1,784,939.780	
DEXCOM INC	9,299	440.730	4,098,348.270	
DISCOVERY INC-A	14,886	29.300	436,159.800	
EXPEDIA GROUP INC	12,635	167.740	2,119,394.900	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,094	50.660	1,119,282.040	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,068	248.950	2,755,378.600	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	26.440	899,568.120	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53,911	118.970	6,413,791.670	
LIVE NATION	15,697	83.660	1,313,211.020	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,668	1,592.250	4,248,123.000	
TRANSDIGM GROUP INC	4,893	660.060	3,229,673.580	
MASTERCARD INC	84,411	372.940	31,480,238.340	
WESTERN UNION CO	35,367	23.310	824,404.770	
OWENS CORNING	9,740	96.350	938,449.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	104.840	1,348,871.440	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	16.120	279,682.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	11,146	168.700	1,880,330.200	
DELTA AIR LINES INC	14,723	42.920	631,911.160	
INSULET CORP	6,122	280.690	1,718,384.180	
DISCOVER FINANCIAL	28,906	122.400	3,538,094.400	
TE CONNECTIVITY LTD	31,111	138.000	4,293,318.000	
MASIMO CORP	5,365	260.330	1,396,670.450	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,647	377.420	4,395,810.740	
VMWARE INC	7,464	159.480	1,190,358.720	
MERCADOLIBRE INC	4,210	1,554.970	6,546,423.700	
ULTA BEAUTY INC	5,259	343.650	1,807,255.350	

INVESCO LTD	39,794	26.330	1,047,776.020	
MSCI INC	7,960	560.230	4,459,430.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	148,059	99.400	14,717,064.600	
VISA INC	161,378	238.470	38,483,811.660	
KEURIG DR PEPPER INC	64,776	35.000	2,267,160.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,257	162.280	2,800,465.960	
DISCOVERY INC-C	30,388	27.770	843,874.760	
MARATHON PETROLEUM CORP	61,181	58.680	3,590,101.080	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,486	98.490	1,328,236.140	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	195,706	18.670	3,653,831.020	
XYLEM INC	17,428	121.050	2,109,659.400	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,636	102.730	2,530,856.280	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	206.220	718,470.480	
SPLUNK INC	15,277	138.370	2,113,878.490	
EPAM SYSTEMS INC	5,349	527.820	2,823,309.180	
ZILLOW GROUP INC	4,265	116.590	497,256.350	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,728	61.170	1,084,421.760	
HCA HEALTHCARE INC	25,366	218.790	5,549,827.140	
VERISK ANALYTICS INC	14,768	181.710	2,683,493.280	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	183.990	1,131,906.480	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,343	253.030	1,857,999.290	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,017	194.490	3,115,146.330	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,918	200.350	5,192,671.300	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	88.800	1,215,405.600	
LEAR CORP	5,733	174.030	997,713.990	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	118.790	1,250,502.330	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	23,036	73.550	1,694,297.800	
DOLLAR GENERAL CORP	23,052	220.770	5,089,190.040	
FORTINET INC	13,050	256.810	3,351,370.500	
HORIZON PHARMA PLC	19,642	95.280	1,871,489.760	
TESLA INC	73,128	656.950	48,041,439.600	
GENERAC HOLDINGS INC	6,138	436.370	2,678,439.060	
ENPHASE ENERGY INC	11,597	183.800	2,131,528.600	
GENERAL MOTORS CO	124,496	58.760	7,315,384.960	
XPO LOGISTICS INC	7,614	141.100	1,074,335.400	
ALLY FINANCIAL INC	34,962	51.280	1,792,851.360	
VOYA FINANCIAL INC	10,611	62.330	661,383.630	
APTIV PLC	25,515	155.610	3,970,389.150	

PHILLIPS 66	41,488	82.700	3,431,057.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	111.660	800,825.520	
FACEBOOK INC	229,029	350.420	80,256,342.180	
IQVIA HOLDINGS INC	17,929	251.160	4,503,047.640	
SERVICENOW INC	18,811	566.370	10,653,986.070	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,413	390.240	3,673,329.120	
WORKDAY INC	16,912	239.940	4,057,865.280	
ABBVIE INC	168,303	116.580	19,620,763.740	
ZOETIS INC	45,433	197.500	8,973,017.500	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	25.520	979,253.440	
CDW CORP	13,668	177.980	2,432,630.640	
HOWMET AEROSPACE INC	34,315	33.950	1,164,994.250	
TWILIO INC	15,096	392.270	5,921,707.920	
COUPA SOFTWARE INC	6,721	266.640	1,792,087.440	
SNAP INC	87,965	65.810	5,788,976.650	
TRADE DESK INC A	40,580	77.950	3,163,211.000	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,557	48.880	907,066.160	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	46.890	390,312.360	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	46.520	660,816.600	
OKTA INC	11,656	251.840	2,935,447.040	
BLACK KNIGHT INC	16,004	80.940	1,295,363.760	
BAKER HUGHES CO	67,871	22.730	1,542,707.830	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	80.820	1,065,288.420	
ALTICE USA INC-A	21,506	34.800	748,408.800	
BROADCOM INC	38,875	480.180	18,666,997.500	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,215	294.810	2,127,054.150	
MONGODB INC	5,041	353.700	1,783,001.700	
BURLINGTON STORES INC	6,573	329.890	2,168,366.970	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	34.640	1,401,153.360	
VEEVA SYSTEMS INC	12,865	321.410	4,134,939.650	
TWITTER INC	75,008	68.970	5,173,301.760	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	57.740	922,973.900	
EVERGY INC	22,104	61.790	1,365,806.160	
ALLEGION PLC	8,924	138.270	1,233,921.480	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	99.220	1,325,579.200	
STERIS PLC	9,656	211.240	2,039,733.440	
DOCUSIGN INC	17,990	288.020	5,181,479.800	
WIX.COM LTD	5,567	294.810	1,641,207.270	
DROPBOX INC	28,170	31.050	874,678.500	
KKR & CO INC	50,809	59.100	3,002,811.900	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	139.750	664,930.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	19,591	385.080	7,544,102.280	
MODERNA INC	30,280	232.810	7,049,486.800	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,893	126.050	3,389,862.650	
ARAMARK	20,857	35.920	749,183.440	

CIGNA CORP	33,710	234.900	7,918,479.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	24,036	100.250	2,409,609.000	
DOW INC	69,681	63.080	4,395,477.480	
AMCOR PLC	153,824	11.510	1,770,514.240	
PINTEREST INC	51,461	76.990	3,961,982.390	
PELTON INTERACTIVE INC	24,251	117.840	2,857,737.840	
FOX CORP-A	31,751	36.450	1,157,323.950	
FOX CORP-B	13,009	34.510	448,940.590	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	31,617	26.340	832,791.780	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	17,209	264.440	4,550,747.960	
CHEWY INC	6,586	85.570	563,564.020	
AVANTOR INC	49,965	36.080	1,802,737.200	
LYFT INC	23,625	60.060	1,418,917.500	
DYNATRACE INC	15,949	61.810	985,807.690	
CLOUDFLARE INC	20,681	108.970	2,253,608.570	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	87.060	860,675.160	
CARRIER GLOBAL CORP	77,461	48.270	3,739,042.470	
OTIS WORLDWIDE CORP	38,820	83.820	3,253,892.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	115,424	49.070	5,663,855.680	
CORTEVA INC	70,517	43.450	3,063,963.650	
MATCH GROUP INC	24,682	162.630	4,014,033.660	
SLACK TECHNOLOGIES INC	43,514	44.470	1,935,067.580	
BLACKSTONE GROUP INC	63,860	99.730	6,368,757.800	
CARLYLE GROUP INC	16,487	47.710	786,594.770	
10X GENOMICS INC	6,780	190.410	1,290,979.800	
DATADOG INC	16,727	108.120	1,808,523.240	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	19,641	87.960	1,727,622.360	
INGERSOLL RAND INC	35,181	49.380	1,737,237.780	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,913	383.590	1,884,577.670	
PPD INC	10,828	45.850	496,463.800	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	106.530	571,746.510	
AON PLC	21,016	236.310	4,966,290.960	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	64.200	1,027,328.400	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	144.150	1,018,275.600	
AIRBNB INC	6,156	149.640	921,183.840	
ZENDESK INC	11,915	143.480	1,709,564.200	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	41.770	704,283.970	
VIATRIS INC	116,960	14.310	1,673,697.600	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	18,899	96.860	1,830,557.140	
DRAFTKINGS INC	14,671	49.090	720,199.390	
SNOWFLAKE INC	2,127	269.490	573,205.230	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	59.570	544,708.080	
ARISTA NETWORKS INC	5,602	378.030	2,117,724.060	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	48,435	23.290	1,128,051.150	
IHS MARKIT LTD	35,312	113.520	4,008,618.240	
FNF GROUP	24,567	44.200	1,085,861.400	



MARVELL TECHNOLOGY INC	77,153	57.000	4,397,721.000	
CATALENT INC	16,458	113.250	1,863,868.500	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,993	48.730	2,631,078.890	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	42,845	45.310	1,941,306.950	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	139.610	482,631.770	
WAYFAIR INC	6,651	303.900	2,021,238.900	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,862	155.810	2,783,078.220	
HUBSPOT INC	4,048	602.900	2,440,539.200	
QORVO INC	11,107	192.940	2,142,984.580	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	172.670	418,724.750	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,950	178.640	2,670,668.000	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	5,031	267.680	1,346,698.080	
GODADDY INC	16,574	87.430	1,449,064.820	
ETSY INC	12,049	195.090	2,350,639.410	
TRANSUNION	18,741	113.840	2,133,475.440	
SQUARE INC	37,352	241.890	9,035,075.280	
DUPONT DE NEMOURS INC	50,291	78.480	3,946,837.680	
CARVANA CO	6,428	323.420	2,078,943.760	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	18,296	61.390	1,123,191.440	
TELADOC HEALTH INC	12,418	158.600	1,969,494.800	
WESTROCK CO	26,297	52.870	1,390,322.390	
KRAFT HEINZ CO	64,743	39.950	2,586,482.850	
NOVOCURE LTD	8,475	194.550	1,648,811.250	
FORTIVE CORP	30,123	70.680	2,129,093.640	
WASTE CONNECTIONS INC	24,861	122.140	3,036,522.540	
ALPHABET INC-CL A	28,694	2,510.370	72,032,556.780	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,591	14.580	1,831,116.780	
PAYPAL HOLDINGS INC	106,102	300.210	31,852,881.420	
SEA LTD ADR	1,322	275.700	364,475.400	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	29.650	1,045,963.050	
SUNRUN INC	16,213	52.580	852,479.540	
ZILLOW GROUP INC-C	15,665	115.290	1,806,017.850	
ALPHABET INC-CL C	27,998	2,591.490	72,556,537.020	
ZSCALER INC	7,764	227.790	1,768,561.560	
CABLE ONE INC	542	1,933.000	1,047,686.000	
LINDE PLC	50,083	292.710	14,659,794.930	
ATHENE HOLDING LTD	13,416	66.920	897,798.720	
ROKU INC	10,251	431.610	4,424,434.110	
AVALARA INC	8,515	161.280	1,373,299.200	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,938	736.470	9,528,448.860	
VISTRA CORP	38,032	19.320	734,778.240	

アメリカ・ドル	小計	30,242,085		3,678,740,639.380 (405,286,856,247)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	14.425	508,639.920	
	ASHTED GROUP	42,475	55.320	2,349,717.000	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	26.470	580,566.510	
	BHP GROUP PLC	197,559	22.620	4,468,784.580	
	BARCLAYS PLC	1,639,400	1.733	2,841,080.200	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	97,947	7.058	691,309.920	
	BT GROUP PLC	864,218	1.875	1,620,408.750	
	BUNZL PLC	34,184	25.560	873,743.040	
	AVIVA PLC	380,790	4.050	1,542,199.500	
	CRODA INTERNATIONAL	12,568	76.380	959,943.840	
	DIAGEO PLC	223,605	34.340	7,678,595.700	
	SCHRODERS PLC	11,354	35.940	408,062.760	
	DCC PLC	7,898	59.600	470,720.800	
	NATIONAL GRID PLC	332,836	9.396	3,127,327.050	
	KINGFISHER PLC	211,460	3.676	777,326.960	
	BAE SYSTEMS PLC	297,008	5.380	1,597,903.040	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	208,432	27.725	5,778,777.200	
	HALMA PLC	38,776	27.750	1,076,034.000	
	NEXT PLC	13,140	78.400	1,030,176.000	
	IMPERIAL BRANDS PLC	91,182	15.845	1,444,778.790	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	31.620	604,163.340	
	ANGLO AMERICAN PLC	125,262	29.910	3,746,586.420	
	COMPASS GROUP PLC	169,036	15.250	2,577,799.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,946,177	4.141	8,059,118.950	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	572,590	2.658	1,521,944.220	
	UNILEVER PLC	250,425	42.950	10,755,753.750	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	2.649	609,831.580	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	10.315	698,469.910	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	21.850	680,977.100	
	PEARSON PLC	65,009	8.214	533,983.920	
	PERSIMMON PLC	28,126	30.040	844,905.040	
PRUDENTIAL PLC	250,932	13.790	3,460,352.280		
RIO TINTO PLC	107,257	61.060	6,549,112.420		
VODAFONE GROUP PLC	2,521,502	1.186	2,990,501.370		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	66,793	64.320	4,296,125.760		
RELX PLC	181,197	20.080	3,638,435.760		
RENTOKIL INITIAL PLC	169,766	5.072	861,053.150		
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	746,540	1.010	754,005.400		
NATWEST GROUP PLC	490,893	2.024	993,567.430		
ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	15.180	755,797.020		

SSE PLC	99,877	15.290	1,527,119.330	
BP PLC	1,962,097	3.109	6,100,159.570	
SAGE GROUP PLC(THE)	110,105	6.938	763,908.490	
SMITHS GROUP PLC	35,235	16.210	571,159.350	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	140.100	921,017.400	
STANDARD CHARTERED PLC	267,266	4.541	1,213,654.900	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,677,834	0.467	3,118,548.470	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.646	570,822.920	
TESCO PLC	746,432	2.377	1,774,268.860	
3I GROUP PLC	87,095	12.025	1,047,317.370	
SMITH & NEPHEW PLC	84,627	15.705	1,329,067.030	
GLAXOSMITHKLINE PLC	470,791	14.352	6,756,792.430	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	31,421	78.720	2,473,461.120	
WPP PLC	124,119	9.676	1,200,975.440	
ASTRAZENECA PLC	125,281	86.480	10,834,300.880	
WHITBREAD PLC	18,594	31.360	583,107.840	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	56.020	904,106.780	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	20.630	799,701.320	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,652	48.230	803,125.960	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.842	519,693.800	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	31.210	626,915.270	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,434	47.580	544,029.720	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	394,623	14.684	5,794,644.130	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	354,122	14.330	5,074,568.260	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	26.230	473,031.820	
AVEVA GROUP PLC	10,408	39.240	408,409.920	
ABRDN PLC	206,313	2.837	585,309.980	
EXPERIAN PLC	88,425	29.380	2,597,926.500	
MONDI PLC	47,464	19.790	939,312.560	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	16.535	583,883.920	
OCADO GROUP PLC	42,789	19.090	816,842.010	
INFORMA PLC	151,566	5.078	769,652.140	
GLENCORE PLC	964,668	3.194	3,081,149.590	
ENTAIN PLC	58,126	18.700	1,086,956.200	
EVRAZ PLC	48,765	6.152	300,002.280	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.924	329,517.250	
COCA-COLA HBC AG	20,233	25.730	520,595.090	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	53,472	6.894	368,635.960	
FERGUSON PLC	21,739	103.500	2,249,986.500	
M&G PLC	259,117	2.278	590,268.520	
JD SPORTS FASHION PLC	47,098	9.570	450,727.860	

	AUTO TRADER GROUP PLC	81,805	6.406	524,042.830	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.595	677,356.620	
イギリス・ポンド 小計		27,773,047		167,964,653.570 (25,717,068,108)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	26.800	2,743,221.200	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	25.240	3,298,943.720	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	417.500	734,800.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	15.550	1,588,183.700	
	ICL GROUP LTD	68,048	21.850	1,486,848.800	
	NICE LTD	5,535	836.000	4,627,260.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	99.500	1,039,178.000	
	AZRIELI GROUP	4,414	240.200	1,060,242.800	
イスラエル・シュケル 小計		425,397		16,578,678.220 (557,416,608)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	63.260	1,066,184.040	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	267,571	27.850	7,451,852.350	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	344,560	25.370	8,741,487.200	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	158,803	23.870	3,790,627.610	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.750	1,366,533.750	
	ASX LTD	19,940	75.540	1,506,267.600	
	BHP GROUP LTD	281,959	49.480	13,951,331.320	
	AMPOL LTD	20,946	29.090	609,319.140	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	16.000	825,664.000	
	CSL LIMITED	43,660	275.470	12,027,020.200	
	REA GROUP LTD	5,828	165.080	962,086.240	
	TRANSURBAN GROUP	261,689	14.420	3,773,555.380	
	COCHLEAR LTD	6,917	243.260	1,682,629.420	
	ORIGIN ENERGY LTD	196,680	4.550	894,894.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	169,844	98.590	16,744,919.960	
	RIO TINTO LIMITED	35,870	125.400	4,498,098.000	
	APA GROUP	118,205	9.110	1,076,847.550	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	41.700	2,156,598.900	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	4.870	1,096,626.600	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,410	44.010	1,734,434.100	
	ORICA LTD	41,311	13.270	548,196.970	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	11.660	724,272.560	
	BLUESCOPE STEEL LTD	46,777	21.260	994,479.020	
	SYDNEY AIRPORT	116,056	7.750	899,434.000	
MACQUARIE GROUP LTD	32,731	154.190	5,046,792.890		
SUNCORP GROUP LTD	118,236	11.270	1,332,519.720		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	311,116	26.080	8,113,905.280	
	NEWCREST MINING LTD	73,202	25.710	1,882,023.420	
	OIL SEARCH LTD	211,926	3.890	824,392.140	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	4.720	293,971.040	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,822	10.500	1,510,131.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	93,404	10.100	943,380.400	
	REECE LTD	30,319	22.990	697,033.810	
	SANTOS LTD	194,614	7.120	1,385,651.680	
	SONIC HEALTHCARE	46,547	38.030	1,770,182.410	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	33.600	282,441.600	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	4.780	1,025,773.660	
	WESFARMERS LTD	107,472	58.000	6,233,376.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	23.440	2,020,434.240	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	119,574	38.070	4,552,182.180	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	51.210	796,469.130	
	SEEK LTD	28,713	31.940	917,093.220	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	114.720	698,185.920	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.755	289,690.830	
	AGL ENERGY LTD	49,076	8.140	399,478.640	
	BRAMBLES LTD	150,237	11.390	1,711,199.430	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	10.990	361,142.390	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.570	644,205.480	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.750	563,062.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	11.900	686,237.300	
	XERO LTD	12,462	134.280	1,673,397.360	
	AFTERPAY LTD	20,778	117.510	2,441,622.780	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	6.250	747,337.500	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.240	917,418.960	
	SOUTH32 LTD(AUD)	497,070	2.930	1,456,415.100	
	COLES GROUP LTD	121,032	16.850	2,039,389.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	30.630	416,690.520	
	オーストラリア・ドル 小計	6,666,397		143,796,587.640 (11,844,524,924)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	24,568	76.520	1,879,943.360	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	81,988	46.340	3,799,323.920	
	BARRICK GOLD CORP	169,906	26.320	4,471,925.920	
	ATCO LTD	7,193	44.260	318,362.180	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	21.150	449,902.800	
	BANK OF MONTREAL	62,248	126.120	7,850,717.760	

BANK OF NOVA SCOTIA	116,344	78.900	9,179,541.600	
NATIONAL BANK OF CANADA	31,010	93.500	2,899,435.000	
BCE INC	7,275	61.990	450,977.250	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	123,552	63.850	7,888,795.200	
BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	36.470	1,028,162.240	
SAPUTO INC	25,395	37.000	939,615.000	
BLACKBERRY LTD	46,671	14.690	685,596.990	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	56,605	18.770	1,062,475.850	
CGI INC	22,007	114.490	2,519,581.430	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	68.640	1,054,173.120	
CAE INC	25,006	38.550	963,981.300	
CAMECO CORP	32,627	22.790	743,569.330	
ROGERS COMM-CL B	35,510	66.690	2,368,161.900	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,847	141.870	5,936,833.890	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	110,821	44.510	4,932,642.710	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	193.870	1,141,700.430	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,291	34.970	569,696.270	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	68,438	133.740	9,152,898.120	
YAMANA GOLD INC	84,317	5.250	442,664.250	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	44.160	919,190.400	
OPEN TEXT CORP	24,883	64.150	1,596,244.450	
EMPIRE CO LTD	15,093	39.860	601,606.980	
KINROSS GOLD CORP	118,575	7.860	931,999.500	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	74.320	740,450.160	
FORTIS INC	44,292	55.610	2,463,078.120	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	28.850	1,641,968.900	
TELUS CORP	31,890	27.960	891,644.400	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	36.780	928,695.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	36.450	785,205.900	
ENBRIDGE INC	194,437	50.110	9,743,238.070	
IGM FINANCIAL INC	6,069	43.980	266,914.620	
MANULIFE FINANCIAL CORP	182,556	23.990	4,379,518.440	
LOBLAW CO LTD	15,136	78.570	1,189,235.520	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,109	112.870	3,172,662.830	
SUN LIFE FINANCIAL INC	54,375	63.290	3,441,393.750	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,398	548.490	1,315,279.020	
METRO INC	25,305	60.520	1,531,458.600	
EMERA INC	22,433	57.090	1,280,699.970	
ONEX CORP	6,646	90.060	598,538.760	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	35.440	665,067.040	
POWER CORP OF CANADA	55,860	38.990	2,177,981.400	
QUEBECOR INC-B	16,042	33.050	530,188.100	

ROYAL BANK OF CANADA	135,699	126.370	17,148,282.630	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	62,219	93.040	5,788,855.760	
SHAW COMM INC-B	47,913	36.180	1,733,492.340	
SUNCOR ENERGY INC	143,571	28.970	4,159,251.870	
LUNDIN MINING CORP	64,310	11.540	742,137.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	29.280	1,200,948.480	
THOMSON REUTERS CORP	16,826	126.310	2,125,292.060	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	104.710	776,634.070	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	173,273	84.700	14,676,223.100	
TC ENERGY CORP	90,472	62.560	5,659,928.320	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,200	93.460	672,912.000	
WESTON (GEORGE) LTD	7,886	119.300	940,799.800	
INTACT FINANCIAL CORP	15,672	172.030	2,696,054.160	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	44,630	55.320	2,468,931.600	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,912	1,919.740	3,670,542.880	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	17,971	183.350	3,294,982.850	
B2GOLD CORP	101,675	5.060	514,475.500	
KEYERA CORP	23,772	33.080	786,377.760	
PARKLAND CORP	14,497	39.680	575,240.960	
ALTAGAS LTD	23,944	26.490	634,276.560	
PEMBINA PIPELINE CORP	50,410	39.910	2,011,863.100	
DOLLARAMA INC	26,906	57.180	1,538,485.080	
CENOVUS ENERGY INC W/I	119,709	11.370	1,361,091.330	
NORTHLAND POWER INC	23,490	42.870	1,007,016.300	
TMX GROUP LTD	5,058	129.310	654,049.980	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,971	49.030	1,322,388.130	
IVANHOE MINES LTD	61,930	9.200	569,756.000	
INTER PIPELINE LTD	41,863	20.120	842,283.560	
NUTRIEN LTD	55,668	76.220	4,243,014.960	
LIGHTSPEED POS INC	9,164	106.020	971,567.280	
WSP GLOBAL INC	10,194	149.910	1,528,182.540	
IA FINANCIAL CORP INC	11,660	67.150	782,969.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	39.500	651,157.500	
NUVEI CORP	4,960	103.490	513,310.400	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	50.870	551,685.150	
AIR CANADA	17,940	25.750	461,955.000	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	80.100	2,016,597.600	
SHOPIFY INC	10,761	1,862.970	20,047,420.170	
FIRSTSERVICE CORP	3,503	222.080	777,946.240	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	27.590	514,112.060	
HYDRO ONE LTD	27,340	30.470	833,049.800	
カナダ・ドル 小計	3,878,221		227,988,479.030	

				(20,163,301,085)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.940	492,500.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	168,400	29.660	4,994,744.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	6.990	254,436.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	11.160	768,924.000	
	CAPITALAND LTD	232,915	3.760	875,760.400	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.840	608,328.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.240	706,876.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	327,653	11.910	3,902,347.230	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.260	1,827,033.720	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	5.020	793,411.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	112,500	25.740	2,895,750.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.310	296,055.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	18.920	397,320.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.510	818,114.000	
シンガポール・ドル 小計	3,140,240		19,631,599.350 (1,600,564,295)		
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	232,092	9.190	2,132,925.480	
	LOGITECH INTL-REG	16,174	114.950	1,859,201.300	
	NESTLE SA-REGISTERED	274,327	115.200	31,602,470.400	
	CIE FINANC RICHEMONT	48,893	110.650	5,410,010.450	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	67,324	353.100	23,772,104.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	280.700	1,157,045.400	
	SIKA INHABER	13,317	309.100	4,116,284.700	
	SGS SA-REG	540	2,896.000	1,563,840.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	211,526	84.940	17,967,018.440	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	144.300	614,573.700	
	BARRY CALLEBAUT AG	401	2,208.000	885,408.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	18.690	373,407.510	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	535.800	1,333,606.200	
	ABB LTD	167,711	32.850	5,509,306.350	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,600	62.580	851,088.000	
	GEBERIT AG	3,524	710.400	2,503,449.600	
	LONZA GROUP AG-REG	6,994	666.800	4,663,599.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	9,525.000	904,875.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	99,200.000	1,091,200.000	
	GIVAUDAN-REG	869	4,333.000	3,765,377.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,488	365.100	5,289,568.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,699	381.400	1,029,398.600	
	HOLCIM LTD	49,333	53.640	2,646,222.120	
TEMENOS GROUP	6,753	147.150	993,703.950		
SONOVA HOLDING AG	5,268	330.200	1,739,493.600		
KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,816	314.600	1,515,113.600		



	STRAUMANN HOLDING AG	1,032	1,545.000	1,594,440.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	310.200	927,808.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	59.550	273,453.600	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	272.000	452,336.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,090	453.300	1,400,697.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	81.000	202,500.000	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	123.900	651,218.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	937.000	527,531.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	94.600	760,584.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,234	1,420.000	3,172,280.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,176	57.600	1,334,937.600	
	SWISS RE LTD	27,789	84.200	2,339,833.800	
	ALCON INC	47,036	64.420	3,030,059.120	
	UBS GROUP AG	354,847	13.675	4,852,532.720	
スイス・フラン	小計	1,656,413		146,810,503.240 (17,692,133,745)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	65,891	543.000	35,778,813.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	458.700	16,536,593.700	
	ERICSSON LM-B SHS	274,779	112.140	30,813,717.060	
	LUNDBERGS B	7,382	571.000	4,215,122.000	
	SKF AB-B SHS	34,849	220.600	7,687,689.400	
	SANDVIK AB	111,867	223.500	25,002,274.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	162,441	111.750	18,152,781.750	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	234.900	7,435,289.700	
	SWEDBANK AB	89,378	163.800	14,640,116.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	149.850	7,933,808.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	98.600	13,728,078.000	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	217.800	5,159,899.800	
	VOLVO AB-B SHS	129,470	211.950	27,441,166.500	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	75.460	11,947,506.340	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	120.050	5,648,952.750	
	INDUSTRIVARDEN A	12,131	330.600	4,010,508.600	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	312.200	3,560,016.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	239.500	4,596,244.500	
	SECURITAS AB-B SHS	35,948	140.200	5,039,909.600	
	INVESTOR AB-B SHS	169,486	205.200	34,778,527.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	198.380	14,064,348.480	
	ASSA ABLOY AB-B	94,311	268.300	25,303,641.300	
	TELIA CO AB	269,954	38.415	10,370,282.910	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	295.900	6,143,475.800	
	BOLIDEN AB	28,603	332.500	9,510,497.500	
	ALFA LAVAL AB	28,392	311.800	8,852,625.600	
	KINNEVIK AB-B	21,722	343.900	7,470,195.800	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	587.400	5,267,215.800	

	ICA GRUPPEN AB	9,009	401.200	3,614,410.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	115.900	3,904,902.800	
	NIBE INDUSTRIER AB	137,747	90.340	12,444,063.980	
	HEXAGON AB-B SHS	187,573	131.200	24,609,577.600	
	EPIROC AB-A	60,750	203.800	12,380,850.000	
	EPIROC AB-B	38,943	173.100	6,741,033.300	
	ESSITY AB-B	58,695	286.600	16,821,987.000	
	EQT AB	20,934	342.300	7,165,708.200	
	EMBRACER GROUP AB	24,571	222.900	5,476,875.900	
	KINNEVIK AB-B	21,722	174.000	3,779,628.000	
	EVOLUTION AB	16,591	1,422.800	23,605,674.800	
	NORDEA BANK ABP	315,042	95.400	30,055,006.800	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	292.700	4,374,401.500	
	SINCH AB	42,790	141.250	6,044,087.500	
スウェーデン・クローナ 小計		3,139,781		532,107,507.020 (6,837,581,465)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	9,728	1,158.500	11,269,888.000	
	A P MOLLER A/S	568	18,045.000	10,249,560.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	17,450.000	5,950,450.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	113.600	7,807,160.000	
	GENMAB A/S	6,269	2,689.000	16,857,341.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,271	474.300	9,614,535.300	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	3,200.000	2,601,600.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	164,338	544.600	89,498,474.800	
	GN STORE NORD A/S	11,641	551.400	6,418,847.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	98,601	241.700	23,831,861.700	
	COLOPLAST-B	10,734	1,049.500	11,265,333.000	
	DSV PANALPINA A S	19,457	1,519.500	29,564,911.500	
	DEMANT A/S	10,739	337.100	3,620,116.900	
	TRYG A/S	35,784	157.900	5,650,293.600	
	PANDORA A/S	9,639	857.800	8,268,334.200	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	561.800	5,244,964.800	
	AMBU A/S B	14,156	224.500	3,178,022.000	
ORSTED A/S	18,540	926.600	17,179,164.000		
デンマーク・クローネ 小計		509,680		268,070,858.200 (4,715,366,396)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.460	822,285.960	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	13.090	647,287.410	
	A2 MILK CO LTD	62,165	7.600	472,454.000	
	FISHER & PAYKEL	57,388	30.000	1,721,640.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.890	780,556.470	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.550	404,357.700	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	5.220	648,125.640	
ニュージーランド・ドル 小計		624,747		5,496,707.180 (423,191,486)	

ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	223.800	9,668,607.600	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	56.400	7,277,630.400	
	TELENOR ASA	63,038	149.650	9,433,636.700	
	SCHIBSTED ASA	7,537	448.000	3,376,576.000	
	ORKLA ASA	65,283	89.680	5,854,579.440	
	EQUINOR ASA	91,961	177.660	16,337,791.260	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	476.600	7,240,983.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	201.600	3,363,292.800	
	ADEVINTA ASA	22,265	173.050	3,852,958.250	
	DNB BANK ASA	89,294	186.950	16,693,513.300	
	SCHIBSTED ASA	7,445	399.600	2,975,022.000	
	ノルウェー・クローネ 小計	550,937		86,074,591.550 (1,092,286,567)	
ユーロ	CRH PLC	74,044	42.400	3,139,465.600	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	16,309	150.800	2,459,397.200	
	KERRY GROUP PLC-A	15,455	120.500	1,862,327.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	84.860	1,141,536.720	
	UMICORE	17,654	51.340	906,356.360	
	AIR LIQUIDE	45,163	147.920	6,680,510.960	
	AIRBUS SE	56,608	112.760	6,383,118.080	
	AXA SA	180,491	21.815	3,937,411.160	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,630	25.950	1,313,848.500	
	ADIDAS AG	18,277	318.450	5,820,310.650	
	ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	16.885	1,647,452.560	
	DASSAULT AVIATION SA	295	988.000	291,460.000	
	DANONE	62,825	59.460	3,735,574.500	
	SAFRAN SA	33,067	119.920	3,965,394.640	
	INTESA SANPAOLO	1,552,995	2.284	3,547,040.580	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	30,673	87.680	2,689,408.640	
	ACCOR SA	17,380	31.410	545,905.800	
	BOUYGUES	21,417	31.760	680,203.920	
	BNP PARIBAS	107,956	50.930	5,498,199.080	
	THALES SA	10,448	89.820	938,439.360	
	CAPGEMINI SA	15,076	167.050	2,518,445.800	
	UNICREDIT SPA	203,331	9.745	1,981,460.590	
	KONINKLIJKE DSM NV	16,537	158.150	2,615,326.550	
	COMMERZBANK AG	106,215	5.706	606,062.790	
	EIFFAGE	8,477	86.900	736,651.300	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	39,898	44.510	1,775,859.980	
	UNITED INTERNET	9,882	33.940	335,395.080	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	41.060	227,718.760	
	PUBLICIS GROUPE	19,879	53.160	1,056,767.640	
	FAURECIA	10,774	40.360	434,838.640	
IBERDROLA SA	549,814	10.280	5,652,087.920		
ENI SPA	238,596	10.080	2,405,047.680		

JERONIMO MARTINS	19,517	16.635	324,665.290	
KESKO OYJ-B	24,085	32.170	774,814.450	
KBC GROUPE	24,033	66.300	1,593,387.900	
HANNOVER RUECK SE	5,923	146.000	864,758.000	
WARTSILA OYJ	48,612	12.785	621,504.420	
L'OREAL	23,954	371.800	8,906,097.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	26,487	662.400	17,544,988.800	
GEA GROUP AG	13,284	35.070	465,869.880	
BOLLORE	71,347	4.494	320,633.410	
MEDIOBANCA SPA	57,442	9.752	560,174.380	
MICHELIN(CGDE) -B	16,350	137.100	2,241,585.000	
CONTINENTAL AG	10,336	118.640	1,226,263.040	
DEUTSCHE POST AG-REG	95,562	58.270	5,568,397.740	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	26.930	571,077.580	
OMV AG	12,817	47.040	602,911.680	
VERBUND AG	6,916	80.450	556,392.200	
PERNOD-RICARD	20,213	180.850	3,655,521.050	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	15,524	92.900	1,442,179.600	
RENAULT SA	19,019	33.500	637,136.500	
REPSOL SA	135,990	9.848	1,339,229.520	
REMY COINTREAU	1,860	178.400	331,824.000	
MERCK KGAA	11,875	169.500	2,012,812.500	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	47,367	57.750	2,735,444.250	
RWE AG	63,738	31.270	1,993,087.260	
SEB SA	2,439	148.700	362,679.300	
SOCIETE GENERALE-A	77,718	24.775	1,925,463.450	
VINCI S.A.	51,385	91.740	4,714,059.900	
SODEXO	9,325	76.120	709,819.000	
SOFINA	1,382	367.600	508,023.200	
SOLVAY SA	7,183	110.000	790,130.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	51,564	137.020	7,065,299.280	
VIVENDI SA	65,938	28.250	1,862,748.500	
SAP SE	99,580	124.720	12,419,617.600	
TELEFONICA S.A	527,117	3.764	1,984,068.380	
TOTALENERGIES SE	238,398	37.450	8,928,005.100	
VALEO	19,653	24.980	490,931.940	
E.ON SE	209,405	10.128	2,120,853.840	
VOEST-ALPINE AG	9,875	35.580	351,352.500	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	78.350	812,176.100	
SIEMENS AG-REG	73,136	132.840	9,715,386.240	
UPM-KYMMENE OYJ	54,222	33.190	1,799,628.180	
ING GROEP NV-CVA	367,322	10.876	3,994,994.070	
PUMA AG	10,448	102.900	1,075,099.200	
BAYER AG	92,074	50.830	4,680,121.420	
STORA ENSO OYJ-R SHS	51,891	16.110	835,964.010	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,809	87.760	1,387,397.840	
DAIMLER AG	82,448	72.890	6,009,634.720	
BASF SE	88,762	68.010	6,036,703.620	
BEIERSDORF AG	10,342	102.150	1,056,435.300	
HEIDELBERGCEMENT AG	15,297	74.620	1,141,462.140	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	19,754	69.000	1,363,026.000	
ASM INTERNATIONAL NV	4,578	278.700	1,275,888.600	
ORANGE	184,093	9.485	1,746,122.100	
SAMPO OYJ-A SHS	46,965	39.650	1,862,162.250	
RANDSTAD NV	11,017	65.160	717,867.720	
ALLIANZ SE	39,464	212.100	8,370,314.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.636	1,245,396.490	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97,453	25.340	2,469,459.020	
HERMES INTL	2,960	1,235.500	3,657,080.000	
ENDESA S.A.	27,736	21.250	589,390.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	10.056	281,467.440	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	31.090	752,502.360	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,138	230.850	3,032,907.300	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,239	26.290	1,767,713.310	
DASSAULT SYSTEMES SA	64,065	42.625	2,730,770.620	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,734	22.120	480,756.080	
HEINEKEN NV	24,566	99.140	2,435,473.240	
AKZO NOBEL	18,548	105.250	1,952,177.000	
ASML HOLDING NV	39,970	583.100	23,306,507.000	
AEGON NV	189,323	3.554	672,853.940	
VOLKSWAGEN AG	2,758	281.200	775,549.600	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,670	212.350	3,752,224.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	643,572	5.227	3,363,950.840	
KERING	7,187	731.200	5,255,134.400	
CNP ASSURANCES	13,987	14.670	205,189.290	
FORTUM OYJ	39,409	23.060	908,771.540	
AGEAS	17,055	46.840	798,856.200	
UCB SA	12,778	90.300	1,153,853.400	
NEMETSCHEK SE	5,095	67.000	341,365.000	
CARREFOUR SA	61,189	16.350	1,000,440.150	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	22.070	521,116.840	
ATOS SE	8,972	52.740	473,183.280	
NOKIA OYJ	510,419	4.654	2,375,490.020	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	88,323	39.060	3,449,896.380	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,053	86.600	2,256,189.800	
SANOFI	107,938	87.220	9,414,352.360	
STMICROELECTRONICS NV	62,523	32.115	2,007,926.140	
ELISA OYJ	13,642	51.520	702,835.840	

BANCO SANTANDER SA	1,669,723	3.129	5,224,563.260	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	15.750	747,384.750	
QIAGEN N.V.	20,763	42.700	886,580.100	
DEUTSCHE BANK AG-REG	188,943	10.500	1,983,901.500	
BMW VORZUG	6,976	75.000	523,200.000	
ENEL SPA	774,910	7.924	6,140,386.840	
COLRUYT NV	4,673	46.900	219,163.700	
VOPAK (KON.)	5,364	38.130	204,529.320	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	311,165	18.000	5,600,970.000	
SARTORIUS AG	2,441	465.000	1,135,065.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	59.780	459,469.080	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	122,634	33.110	4,060,411.740	
RATIONAL AG	479	798.600	382,529.400	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	166.250	626,928.750	
BECHTLE AG	2,511	161.350	405,149.850	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	2.684	916,443.740	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,226	101.580	1,343,497.080	
TELEPERFORMANCE	5,626	348.000	1,957,848.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,989	144.450	2,598,511.050	
EURAZEO	3,007	73.800	221,916.600	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	95.380	944,643.520	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	84.300	843,337.200	
INDITEX	102,523	29.730	3,048,008.790	
ESSILORLUXOTTICA	26,761	154.340	4,130,292.740	
SNAM SPA	198,963	4.892	973,326.990	
CREDIT AGRICOLE SA	108,321	11.794	1,277,537.870	
ORPEA	4,932	106.650	525,997.800	
ENAGAS	23,477	18.330	430,333.410	
WENDEL	2,220	109.700	243,534.000	
TENARIS SA	52,985	9.002	476,970.970	
TELECOM ITALIA SPA	1,123,551	0.391	439,308.440	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.428	212,971.080	
ATLANTIA SPA	45,299	15.440	699,416.560	
ILIAD SA	1,046	120.550	126,095.300	
PROXIMUS	13,739	16.545	227,311.750	
TERNA SPA	126,172	6.422	810,276.580	
BIOMERIEUX	3,248	93.820	304,727.360	
GRIFOLS SA	30,687	21.680	665,294.160	
FERROVIAL SA	46,794	25.460	1,191,375.240	
LANXESS AG	6,856	58.420	400,527.520	
NESTE OYJ	39,886	52.280	2,085,240.080	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	18.890	338,338.790	
RECORDATI SPA	10,303	50.200	517,210.600	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	11.180	618,298.720	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,873	213.800	1,041,847.400	

KONE OYJ	32,102	69.760	2,239,435.520	
ELIA GROUP	2,862	90.650	259,440.300	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,771	434.300	1,203,445.300	
ENGIE	166,851	11.606	1,936,472.700	
ALSTOM	26,382	37.830	998,031.060	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	11.375	623,099.750	
IPSEN SA	3,646	88.000	320,848.000	
DEUTSCHE WOHNEN	33,021	51.580	1,703,223.180	
ARKEMA SA	6,393	106.800	682,772.400	
LEGRAND SA	25,357	91.700	2,325,236.900	
AMPLIFON SPA	11,372	38.070	432,932.040	
ADP	2,313	111.050	256,858.650	
ORION OYJ	8,051	37.210	299,577.710	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	8.978	359,910.060	
SYMRISE AG	12,698	120.200	1,526,299.600	
SCOR SE	15,667	25.590	400,918.530	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	46.390	1,123,936.920	
PRYSMIAN SPA	22,328	30.520	681,450.560	
DIASORIN SPA	2,223	160.650	357,124.950	
CAIXABANK	394,299	2.555	1,007,433.940	
BUREAU VERITAS SA	29,810	26.850	800,398.500	
GETLINK	50,458	13.860	699,347.880	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	20.480	572,866.560	
SUEZ SA	34,245	19.545	669,318.520	
AMADEUS IT GROUP SA	43,588	57.580	2,509,797.040	
BRENNTAG SE	14,044	81.860	1,149,641.840	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	28.730	670,558.200	
EDENRED	24,865	48.610	1,208,687.650	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.430	239,075.550	
LEG IMMOBILIEN SE	6,537	130.800	855,039.600	
KION GROUP AG	7,508	92.260	692,688.080	
VONOVIA SE	51,151	57.620	2,947,320.620	
KNORR-BREMSE AG	6,860	96.160	659,657.600	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	26,679	53.220	1,419,856.380	
FERRARI NV	11,553	176.000	2,033,328.000	
CNH INDUSTRIAL NV	101,681	13.675	1,390,487.670	
AROUNDTOWN SA	106,018	6.664	706,503.950	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	49.030	396,750.760	
MONCLER SPA	17,567	56.360	990,076.120	
NEXI SPA	43,586	18.540	808,084.440	
TEAMVIEWER AG	13,668	28.120	384,344.160	
PROSUS NV	45,840	77.360	3,546,182.400	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	21,717	1.250	27,146.250	
JDE PEET'S BV	7,308	31.130	227,498.040	

	SIEMENS ENERGY AG	35,831	25.880	927,306.280	
	INPOST SA	20,395	17.696	360,909.920	
	WORLDLINE SA	23,570	80.830	1,905,163.100	
	NN GROUP NV	28,556	40.620	1,159,944.720	
	FINCOBANK SPA	53,818	14.950	804,579.100	
	ARGENX SE	4,403	261.900	1,153,145.700	
	IBERDROLA SA-RTS	549,814	0.255	140,202.570	
	ZALANDO SE	15,459	101.500	1,569,088.500	
	STELLANTIS NV	195,811	16.486	3,228,140.140	
	AENA SME SA	7,240	138.650	1,003,826.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	49,741	54.560	2,713,868.960	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,836	74.890	1,260,848.040	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	10.050	344,222.550	
	EXOR NV	9,966	66.700	664,732.200	
	SCOUT24 AG	9,670	70.820	684,829.400	
	COVESTRO AG	19,158	56.140	1,075,530.120	
	HELLOFRESH SE	15,236	82.340	1,254,532.240	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	70,978	58.880	4,179,184.640	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	10.995	612,960.250	
	AMUNDI SA	5,924	75.800	449,039.200	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	39,494	9.702	383,170.780	
	ADYEN NV	1,855	2,118.500	3,929,817.500	
	UNIPER SE	10,427	31.650	330,014.550	
	DELIVERY HERO SE	14,389	119.150	1,714,449.350	
ユーロ	小計	18,651,499		451,067,277.790 (59,008,621,280)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.180	2,981,520.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	13.720	1,424,959.200	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	77.250	12,514,500.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	45.250	2,239,875.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	112,740	490.000	55,242,600.000	
	MTR CORP	126,000	44.200	5,569,200.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	152.500	11,559,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	36.400	4,202,380.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	47.300	6,905,800.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,074,456	12.240	13,151,341.440	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	224,000	59.600	13,350,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	25.400	8,064,500.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	37.350	6,090,515.100	
	SINO LAND CO	255,400	12.480	3,187,392.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,500	113.500	13,676,750.000	



SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	51.500	2,549,250.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	130,500	131.300	17,134,650.000	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	30.950	5,137,700.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.170	1,274,520.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	11.640	1,448,016.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	17.100	3,714,120.000	
AIA GROUP LTD	1,153,827	94.550	109,094,342.850	
HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.520	4,681,400.000	
SANDS CHINA LTD	252,000	30.850	7,774,200.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	22.350	2,328,870.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	43.750	6,551,562.500	
ESR CAYMAN LTD	203,800	24.700	5,033,860.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.850	1,805,500.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	23.600	3,554,160.000	
WH GROUP LTD	897,000	6.610	5,929,170.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	260,832	57.650	15,036,964.800	
CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	52.900	11,893,612.800	
香港・ドル 小計	8,125,713		365,103,131.690 (5,177,162,407)	
合計	105,384,157		560,116,074,613 (560,116,074,613)	

## (2) 株式以外の有価証券

2021年7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	118,215.000	1,221,160.950	
		GOODMAN GROUP	160,839.000	3,432,304.260	
		GPT GROUP	207,292.000	1,003,293.280	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,213,386.250	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,315,027.500	
		STOCKLAND	243,481.000	1,102,968.930	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	578,010.600	
	オーストラリア・ドル 小計		2,000,913.000	9,866,151.770 (812,674,921)	
シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	880,744.060	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	498,836.000	1,067,509.040	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	421,137.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	567,210.000	

	シンガポール・ドル 小計		1,253,842.000	2,936,600.100 (239,421,006)	
投資信託受益証券 合計			3,254,755	1,052,095,927 (1,052,095,927)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	777,412.920	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,466.000	2,375,396.300	
		AMERICAN TOWER CORP	42,405.000	11,807,672.250	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559.000	1,136,550.690	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,300.000	2,937,039.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,549.000	1,704,706.330	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,873.000	1,252,690.140	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	41,234.000	8,317,722.480	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	26,971.000	4,201,002.960	
		DUKE REALTY TRUST	35,962.000	1,792,705.700	
		EQUINIX INC	8,565.000	7,026,040.800	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,554.000	1,221,611.160	
		EQUITY RESIDENTIAL	32,922.000	2,690,056.620	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,408.000	2,052,097.920	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,714.000	2,201,937.660	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,001.000	1,842,314.760	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952.000	1,094,218.720	
		INVITATION HOMES INC	54,837.000	2,187,996.300	
		IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,243,965.600	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911.000	1,105,175.500	
		MID AMERICA	11,430.000	2,065,401.000	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	743,614.050	
		PROLOGIS INC	70,664.000	8,860,558.960	
		PUBLIC STORAGE	15,117.000	4,711,666.560	
		REALTY INCOME CORP	35,640.000	2,454,526.800	
		REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	942,579.990	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,565.000	3,479,371.450	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	30,857.000	4,001,844.330	
		SUN COMMUNITIES INC	10,801.000	1,953,576.870	
		UDR INC	26,674.000	1,385,981.040	
		VENTAS INC	35,060.000	2,055,918.400	
		VEREIT INC	19,960.000	950,894.400	
		VICI PROPERTIES INC	48,258.000	1,517,231.520	
VORNADO REALTY TRUST	17,313.000	805,400.760			
WELLTOWER INC	39,394.000	3,404,823.420			
WEYERHAEUSER CO	69,174.000	2,477,812.680			
WP CAREY INC	15,529.000	1,210,796.130			

アメリカ・ドル 小計		1,190,581.000	101,990,312.170 (11,236,272,693)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	359,707.480	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	509,904.860	
	SEGRO PLC	116,375.000	1,355,186.870	
イギリス・ポンド 小計		260,222.000	2,224,799.210 (340,639,007)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,220.000	503,803.800	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	309,741.000	
カナダ・ドル 小計		21,687.000	813,544.800 (71,949,902)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	361,382.500	
	GECINA SA	4,763.000	632,764.550	
	KLEPIERRE	17,099.000	378,913.840	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	974,555.600	
ユーロ 小計		39,445.000	2,347,616.490 (307,115,189)	
香港・ドル	LINK REIT	204,300.000	15,148,845.000	
香港・ドル 小計		204,300.000	15,148,845.000 (214,810,622)	
投資証券 合計		1,716,235	12,170,787,413 (12,170,787,413)	
合計			13,222,883,340 (13,222,883,340)	

(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 600銘柄	69.67	-	-	72.65
	投資証券 37銘柄	-	-	1.93	
イギリス・ポンド	株式 83銘柄	4.42	-	-	4.54
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄	2.04	-	-	2.21
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.14	-	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.47	-	-	3.53
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.28	-	-	0.32
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 40銘柄	3.04	-	-	3.09

スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	1.18	-	-	1.19
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.81	-	-	0.82
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.07	-	-	0.07
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.19	-	-	0.19
ユーロ	株式	233銘柄	10.14	-	-	10.35
	投資証券	4銘柄	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	32銘柄	0.89	-	-	0.94
	投資証券	1銘柄	-	-	0.04	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年7月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,148,195,870
コール・ローン	362,494,273
国債証券	153,533,513,819
未収利息	1,662,345,265
前払費用	401,843,905
流動資産合計	157,108,393,132
資産合計	157,108,393,132
負債の部	
流動負債	
未払金	426,798,580
未払解約金	245,471,000
流動負債合計	672,269,580
負債合計	672,269,580
純資産の部	
元本等	
元本	71,691,455,689
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	84,744,667,863
元本等合計	156,436,123,552
純資産合計	156,436,123,552
負債純資産合計	157,108,393,132

## 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1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年7月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	68,481,201,187円
同期中追加設定元本額	59,370,368,934円
同期中一部解約元本額	56,160,114,432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）	200,891,579円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,166,676,004円
たわらノーロード バランス（堅実型）	88,739,552円
たわらノーロード バランス（標準型）	234,201,830円
たわらノーロード バランス（積極型）	96,248,268円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	945,000円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,620,691円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	9,746,430円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,545,096円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,889,848円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	50,537,183円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	202,138,086円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	275,347,290円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	548,520,300円
投資のソムリエ	17,988,990,853円
クルーズコントロール	355,525,667円
投資のソムリエ<DC年金>	949,009,625円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	194,129,245円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	2,656,636円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	6,900,790円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	717,670,605円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	7,264,588,649円
ワールドアセットバランス（基本コース）	632,061,212円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,035,467,015円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	19,039,872円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	9,125,892円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	6,796,597円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	53,217,219円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,045,767,967円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	190,995,096円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	15,343,769円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	6,984,718円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,008,648円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	63,866円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	23,568,549,802円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	477,704,679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)	3,646,174,808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)	836,481,092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)	11,102,676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)	200,117,677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)	100,654,107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)	6,045,495,831円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	425,783,919円
計	71,691,455,689円
2. 受益権の総数	71,691,455,689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1月13日 至 2021年7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	1,709,804,897	
合計	1,709,804,897	

(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(2021年4月20日から2021年7月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年7月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1821円 (21,821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

2021年7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.875 06/06/25	10,000,000.000	10,285,000.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	16,000,000.000	16,129,600.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	10,000,000.000	10,657,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	14,800,000.000	16,009,530.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	14,000,000.000	13,513,360.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	15,800,000.000	15,950,495.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	11,100,000.000	12,003,429.000	



BRAZIL 5.625 02/21/47	10,600,000.000	11,499,887.000	
BRAZIL 6.0 04/07/26	10,800,000.000	12,632,166.000	
BRAZIL 7.125 01/20/37	8,300,000.000	10,487,838.500	
BRAZIL 8.25 01/20/34	10,200,000.000	14,108,640.000	
BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	5,934,480.000	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	9,000,000.000	8,797,095.000	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	13,000,000.000	12,693,070.000	
COLOMBIA 4.0 02/26/24	8,100,000.000	8,566,519.500	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	7,000,000.000	6,615,770.000	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	9,000,000.000	9,823,545.000	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	10,000,000.000	10,891,100.000	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	21,000,000.000	22,267,350.000	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	7,641,900.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	13,000,000.000	14,673,100.000	
COLOMBIA 6.125 01/18/41	12,000,000.000	14,142,360.000	
COLOMBIA 7.375 09/18/37	10,400,000.000	13,665,184.000	
CROATIA 5.5 04/04/23	12,400,000.000	13,456,095.600	
CROATIA 6.0 01/26/24	14,400,000.000	16,328,736.000	
HUNGARY 5.375 02/21/23	10,358,000.000	11,200,612.940	
HUNGARY 5.375 03/25/24	13,380,000.000	15,090,499.200	
HUNGARY 5.75 11/22/23	13,000,000.000	14,600,560.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	9,000,000.000	14,852,637.000	
INDONESIA 2.85 02/14/30	7,000,000.000	7,291,620.840	
INDONESIA 3.375 04/15/23	6,700,000.000	7,054,798.700	
INDONESIA 3.4 09/18/29	5,000,000.000	5,418,525.000	
INDONESIA 3.5 01/11/28	7,200,000.000	7,882,488.000	
INDONESIA 3.7 10/30/49	4,000,000.000	4,259,259.680	
INDONESIA 3.85 07/18/27	5,600,000.000	6,237,280.000	
INDONESIA 3.85 10/15/30	8,000,000.000	8,927,959.280	
INDONESIA 4.1 04/24/28	6,000,000.000	6,800,160.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	9,800,000.000	10,852,747.160	
INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	8,076,354.510	
INDONESIA 4.35 01/08/27	7,000,000.000	7,944,304.200	
INDONESIA 4.35 01/11/48	7,000,000.000	8,056,595.330	
INDONESIA 4.45 04/15/70	5,000,000.000	6,009,836.150	
INDONESIA 4.75 01/08/26	10,800,000.000	12,360,898.620	
INDONESIA 4.75 02/11/29	7,000,000.000	8,219,500.520	
INDONESIA 5.125 01/15/45	8,400,000.000	10,549,083.800	
INDONESIA 5.25 01/17/42	9,300,000.000	11,801,996.670	
INDONESIA 5.35 02/11/49	4,000,000.000	5,270,559.640	
INDONESIA 5.875 01/15/24	9,200,000.000	10,390,524.430	
INDONESIA 5.95 01/08/46	6,200,000.000	8,650,643.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	9,500,000.000	14,185,004.510	
INDONESIA 7.75 01/17/38	11,500,000.000	17,592,182.500	
PANAMA 2.252 09/29/32	13,000,000.000	12,626,380.000	
PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	8,441,600.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	7,200,000.000	7,846,416.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	8,100,000.000	8,959,450.500	
PANAMA 4.5 04/01/56	12,000,000.000	13,847,640.000	

PANAMA 4.5 04/16/50	11,300,000.000	13,031,160.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	12,900,000.000	17,691,060.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	5,800,000.000	7,203,716.000	
PERU 2.392 01/23/26	6,000,000.000	6,200,820.000	
PERU 2.78 12/01/60	10,000,000.000	9,143,400.000	
PERU 2.783 01/23/31	17,000,000.000	17,446,420.000	
PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	5,168,450.000	
PERU 4.125 08/25/27	7,300,000.000	8,202,134.000	
PERU 5.625 11/18/50	12,000,000.000	16,823,400.000	
PERU 6.55 03/14/37	9,000,000.000	12,481,200.000	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	4,000,000.000	3,878,536.360	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	6,000,000.000	6,266,070.600	
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	6,000,000.000	5,891,999.160	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	11,000,000.000	11,909,977.640	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	8,000,000.000	8,774,200.000	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	8,000,000.000	9,099,640.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	9,800,000.000	11,029,682.140	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	7,800,000.000	8,546,688.300	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	6,800,000.000	8,613,561.970	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	9,600,000.000	11,635,950.520	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	10,000,000.000	14,147,130.800	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	8,100,000.000	12,003,592.500	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	7,800,000.000	12,344,893.470	
ROMANIA 3.0 02/14/31	11,000,000.000	11,442,200.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	12,000,000.000	12,746,880.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	7,600,000.000	8,377,092.400	
ROMANIA 5.125 06/15/48	7,600,000.000	9,408,047.600	
ROMANIA 6.125 01/22/44	9,400,000.000	12,918,185.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	10,440,000.000	12,026,034.330	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	15,400,000.000	17,257,625.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	15,400,000.000	17,392,760.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	3,800,000.000	3,913,730.200	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	18,400,000.000	20,950,700.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	16,400,000.000	17,837,050.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	22,000,000.000	26,314,772.000	

RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	27,000,000.000	34,207,326.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	16,000,000.000	20,720,320.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	8,200,000.000	11,029,123.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	13,200,000.000	13,711,896.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	14,000,000.000	14,931,700.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	10,400,000.000	11,346,400.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	8,200,000.000	8,405,000.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	13,000,000.000	13,301,600.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,141,894.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	9,400,000.000	10,774,449.200	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	14,200,000.000	16,090,701.600	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,000,000.000	4,392,228.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	12,000,000.000	11,793,600.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	11,000,000.000	11,429,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	10,137,664.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	11,200,000.000	12,261,816.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	7,000,000.000	7,786,100.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	2,418,000.000	2,623,203.570	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	11,000,000.000	12,457,940.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	12,400,000.000	14,060,298.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	10,000,000.000	10,707,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	16,000,000.000	18,150,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	13,000,000.000	14,069,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	11,400,000.000	12,291,081.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	14,000,000.000	16,100,000.000	

	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	10,000,000.000	11,418,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	12,400,000.000	15,097,124.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	11,800,000.000	14,198,350.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	14,900,000.000	18,782,269.500	
	アメリカ・ドル 小計	1,216,896,000.000 (134,065,432,320)	1,393,605,462.640 (153,533,513,819)	
国債証券 合計		134,065,432,320 (134,065,432,320)	153,533,513,819 (153,533,513,819)	
合計			153,533,513,819 (153,533,513,819)	

(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 120銘柄	98.14	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）

2021年7月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,068,649,251
コール・ローン	506,722,555
株式	52,826,219,697
投資信託受益証券	384,013,694
投資証券	49,383,108
派生商品評価勘定	1,130,058
未収入金	6,721,893
未収配当金	191,297,296
差入委託証拠金	3,181,470,095
流動資産合計	60,215,607,647
資産合計	
60,215,607,647	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	200,073,005
未払金	38,362,648
未払解約金	371,950,000
流動負債合計	610,385,653
負債合計	
610,385,653	
純資産の部	
元本等	
元本	40,256,641,322
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,348,580,672
元本等合計	59,605,221,994
純資産合計	
59,605,221,994	
負債純資産合計	
60,215,607,647	

## 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1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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	2021年7月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	64,399,345,495円
同期中追加設定元本額	15,870,931,455円
同期中一部解約元本額	40,013,635,628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 >	7,609,314,688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)	349,014,059円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,058,239円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,723,922円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	10,411,187円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,428,792円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,426,555円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,664,759円
たわらノーロード 新興国株式	7,761,831,732円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,106,249,753円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,680,990,299円
たわらノーロード バランス(堅実型)	16,130,445円
たわらノーロード バランス(標準型)	54,959,337円
たわらノーロード バランス(積極型)	91,972,937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)	899,929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)	95,172,877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)	200,165,906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)	128,667,276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)	216,614,615円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	271,565円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,932,838円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,309,081円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,558,519円
たわらノーロード 全世界株式	66,338,609円
One DC 新興国株式インデックスファンド	240,571,761円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	334,605,434円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	329,145,943円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	384,832,627円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	787,054,334円
投資のソムリエ	7,329,994,593円
クルーズコントロール	505,768,379円
投資のソムリエ<DC年金>	381,583,357円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	320,081,299円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	9,398,223円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	24,550,860円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	288,647,335円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,921,374,126円
ワールドアセットバランス(基本コース)	866,000,074円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,825,159,926円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	23,122,059円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,127,007円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,708,159円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	30,182,034円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,241,569,657円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	274,292,308円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	13,148,219円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	8,497,686円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,352,586円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	77,320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)	15,484,954円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	191,263,536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)	282,073,008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)	141,866,599円
計	40,256,641,322円

2. 受益権の総数

40,256,641,322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1月13日 至 2021年7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券



種類	2021年7月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	1,072,477,444	
投資信託受益証券	22,083,306	
投資証券	418,443	
合計	1,049,975,695	

(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(2021年4月20日から2021年7月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

#### 通貨関連

種類	2021年7月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	111,413,390	-	111,489,794	76,404	
	111,413,390	-	111,489,794	76,404	
合計	111,413,390	-	111,489,794	76,404	

(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	2021年7月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	6,600,034,063	-	6,401,014,712	199,019,351	
合計	6,600,034,063	-	6,401,014,712	199,019,351	

(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)

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4806円 (14,806円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年7月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	30,150	32.180	970,227.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	8,898	8.590	76,433.820	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	6.360	153,975.600	
	CREDICORP LTD	4,299	119.400	513,300.600	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	35,762	8.540	305,407.480	
	NETEASE INC-ADR	23,636	108.330	2,560,487.880	
	SOUTHERN COPPER CORP	4,518	65.180	294,483.240	
	YPF SA ADR	4,248	4.320	18,351.360	
	LUKOIL SPON ADR	25,186	89.520	2,254,650.720	
	GAZPROM PAO ADR	351,271	7.900	2,775,040.900	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	72,118	3.510	253,134.180	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,388	0.945	91,086.660	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	56,784	4.714	267,679.770	
	51JOB INC ADR	2,101	77.550	162,932.550	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	7,085	33.350	236,284.750	
	NOVATEK PJSC GDR	5,500	216.100	1,188,550.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	15,867	181.360	2,877,639.120	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	10,730	31.420	337,136.600	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	38,025	33.390	1,269,654.750	
	ROSNEFT OIL CO GDR	58,131	7.696	447,376.170	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	92,139	6.600	608,117.400		
SEVERSTAL GDR	15,471	21.760	336,648.960		
TATNEFT ADR	15,024	41.840	628,604.160		
VTB BANK OJSC GDR	112,000	1.296	145,152.000		

MAGNIT PJSC GDR	16,621	14.275	237,264.770	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	27,011	18.780	507,266.580	
21VIANET GROUP INC ADR	4,106	19.740	81,052.440	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	21.220	522,606.160	
MAIL.RU GROUP LTD GDR	6,853	21.680	148,573.040	
YANDEX NV	18,499	70.440	1,303,069.560	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,716	44.190	75,830.040	
SBERBANK ADR	160,668	16.395	2,634,151.860	
PHOSAGRO PJSC GDR	8,308	19.670	163,418.360	
ADECOAGRO SA	5,000	9.540	47,700.000	
HUAZHU GROUP LTD ADR	10,775	49.490	533,254.750	
JOYY INC-ADR	3,647	59.940	218,601.180	
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	3,303	67.800	223,943.400	
GDS HOLDINGS LTD ADR	5,777	70.450	406,989.650	
ZAI LAB LTD ADR	4,538	169.000	766,922.000	
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	7,502	89.100	668,428.200	
HUYA INC ADR	4,204	15.130	63,606.520	
360 DIGITECH INC ADR	5,813	26.310	152,940.030	
BILIBILI INC ADR	9,699	106.740	1,035,271.260	
NIO INC ADR	76,062	45.530	3,463,102.860	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	40,897	12.880	526,753.360	
AUTOHOME INC ADR	4,265	61.830	263,704.950	
UP FINTECH HOLDING LTD ADR	5,517	20.510	113,153.670	
DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR	7,360	5.450	40,112.000	
GAOTU TECHEDU INC ADR	4,275	13.210	56,472.750	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNOLOGY CO LTD ADR	7,893	10.590	83,586.870	
I-MAB ADR	2,148	80.700	173,343.600	
WEIBO CORP ADR	3,003	60.030	180,270.090	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	2,911	29.690	86,427.590	
BURNING ROCK BIOTECH LTD ADR	2,868	27.410	78,611.880	
RLX TECHNOLOGY INC ADR	3,000	7.960	23,880.000	
KE HOLDINGS INC ADR	21,054	40.750	857,950.500	
CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	6,336	13.950	88,387.200	
DADA NEXUS LTD ADR	4,179	26.210	109,531.590	
JD.COM INC ADR	50,835	73.560	3,739,422.600	
AGORA INC ADR	3,131	37.900	118,664.900	
LI AUTO INC ADR	28,419	31.820	904,292.580	
XPENG INC ADR	22,389	39.920	893,768.880	
OZON HOLDINGS PLC ADR	2,945	55.595	163,727.270	

	LUFAX HOLDING LTD ADR	11,272	9.550	107,647.600	
	GLOBANT SA	2,498	220.010	549,584.980	
	MOMO INC SPON ADR	7,793	13.660	106,452.380	
	BAOZUN INC-SPN ADR	4,490	32.990	148,125.100	
	PINDUODUO INC ADR	25,812	111.070	2,866,938.840	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	24,702	65.360	1,614,522.720	
	IQIYI INC ADR	15,440	13.190	203,653.600	
	POLYUS PJSC GDR	4,381	95.150	416,852.150	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	3,761	37.520	141,112.720	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	26,312	29.080	765,152.960	
	BEIGENE LTD ADR	2,729	329.250	898,523.250	
アメリカ・ドル	小計	1,866,886		48,346,976.910 (5,326,386,446)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	114,269	5.500	628,479.500	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	94,296	4.800	452,620.800	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	107,147	22.040	2,361,519.880	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	176,404	6.730	1,187,198.920	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	251,763	16.280	4,098,701.640	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	187,397	4.000	749,588.000	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	224,384	3.810	854,903.040	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	138,597	13.100	1,815,620.700	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	159,897	4.340	693,952.980	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	1,454,154		12,842,585.460 (384,635,435)	
イギリス・ポ ンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	22,906	15.855	363,174.630	
イギリス・ポ ンド	小計	22,906		363,174.630 (55,605,668)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	166,403	2,071.200	344,653,893.600	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	51,564	456.900	23,559,591.600	
	ASIAN PAINTS LTD	23,101	3,010.600	69,547,870.600	
	EICHER MOTORS LTD	8,743	2,712.150	23,712,327.450	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	13,338	1,500.150	20,009,000.700	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	52,399	771.550	40,428,448.450	
	SHREE CEMENT LTD	581	27,502.750	15,979,097.750	
	ICICI BANK LTD	299,985	638.550	191,555,421.750	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	37,298	278.950	10,404,277.100	
	STATE BANK OF INDIA LTD	106,595	423.750	45,169,631.250	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,949	673.950	7,379,078.550	
TATA STEEL LTD	37,523	1,239.350	46,504,130.050	
TATA MOTORS LTD	101,027	306.300	30,944,570.100	
JSW STEEL LTD	50,822	681.550	34,637,734.100	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	37,935	765.950	29,056,313.250	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	6,300	3,475.950	21,898,485.000	
NESTLE INDIA LTD	2,001	17,636.000	35,289,636.000	
GAIL INDIA LTD	83,449	147.150	12,279,520.350	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	32,663	1,720.050	56,181,993.150	
VEDANTA LTD	48,843	271.550	13,263,316.650	
AXIS BANK LTD	134,205	747.350	100,298,106.750	
TITAN COMPANY LTD	21,618	1,720.600	37,195,930.800	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	155,474	117.900	18,330,384.600	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	6,531	1,724.000	11,259,444.000	
BHARAT ELECTRONICS LTD	82,654	180.850	14,947,975.900	
LUPIN LTD	12,780	1,147.850	14,669,523.000	
ACC LTD	3,592	2,037.250	7,317,802.000	
BAJAJ FINANCE LTD	16,003	6,136.150	98,196,808.450	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	100,287	2,496.450	250,361,481.150	
INFOSYS LTD	199,050	1,562.900	311,095,245.000	
WIPRO LTD	81,673	525.800	42,943,663.400	
MRF LTD	96	79,994.700	7,679,491.200	
INDIAN OIL CORP LTD	125,755	107.300	13,493,511.500	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	47,777	2,451.450	117,122,926.650	
TRENT LTD	9,385	905.300	8,496,240.500	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	4,770	3,725.900	17,772,543.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	64,008	976.850	62,526,214.800	
DABUR INDIA LTD	39,316	595.600	23,416,609.600	
HERO MOTOCORP LTD	7,629	2,896.800	22,099,687.200	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,357	2,280.200	14,495,231.400	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,250	5,460.300	39,587,175.000	
IPCA LABORATORIES LTD	2,666	2,089.550	5,570,740.300	
BHARTI AIRTEL LTD	144,412	536.250	77,440,935.000	
UNITED SPIRITS LTD	15,017	655.250	9,839,889.250	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	51,875	667.900	34,647,312.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	8,146	4,599.700	37,469,156.200	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,114	7,425.700	60,252,129.800	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,868	948.700	17,900,071.600	
HAVELLS INDIA LTD	11,619	1,023.350	11,890,303.650	

INDRAPRASTHA GAS LTD	11,498	570.050	6,554,434.900	
BIOCON LTD	21,917	388.550	8,515,850.350	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	67,610	236.350	15,979,623.500	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	9,353	1,455.700	13,615,162.100	
PETRONET LNG LTD	52,703	224.000	11,805,472.000	
CIPLA LTD/INDIA	30,575	959.800	29,345,885.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	41,053	1,499.600	61,563,078.800	
ULTRATECH CEMENT LTD	5,327	6,899.550	36,753,902.850	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	53,622	3,208.150	172,027,419.300	
ADANI ENTERPRISES LTD	17,203	1,431.350	24,623,514.050	
NTPC LTD	295,091	117.800	34,761,719.800	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,327	2,312.150	12,316,823.050	
YES BANK LTD	714,850	13.250	9,471,762.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	34,517	363.600	12,550,381.200	
BHARAT FORGE LTD	18,024	808.000	14,563,392.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	97,347	390.050	37,970,197.350	
ITC LTD	175,871	201.350	35,411,625.850	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,676	2,277.800	19,762,192.800	
UNITED PHOSPHORUS LTD	31,183	814.550	25,400,112.650	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,521	3,005.050	7,575,731.050	
SIEMENS INDIA LTD	3,637	2,002.150	7,281,819.550	
INFO EDGE INDIA LTD	4,882	5,381.900	26,274,435.800	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,093	965.650	17,471,505.450	
TECH MAHINDRA LTD	38,981	1,051.750	40,998,266.750	
MARICO LTD	26,696	531.950	14,200,937.200	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	31,357.850	11,853,267.300	
DLF LTD	33,709	300.350	10,124,498.150	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	143,220	230.250	32,976,405.000	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	31,292	728.500	22,796,222.000	
REC LTD	45,037	145.350	6,546,127.950	
BAJAJ FINSERV LTD	2,329	12,854.750	29,938,712.750	
BAJAJ AUTO LTD	3,052	3,995.900	12,195,486.800	
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,592	3,108.750	17,384,130.000	
MUTHOOT FINANCE LTD	4,965	1,534.600	7,619,289.000	
COAL INDIA LTD	100,287	146.700	14,712,102.900	
INDUS TOWERS LTD	37,374	241.500	9,025,821.000	
PI INDUSTRIES LTD	4,133	2,992.150	12,366,555.950	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	2,748	4,054.100	11,140,666.800	
ADANI GREEN ENERGY LTD	23,447	1,019.400	23,901,871.800	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	48,563	683.250	33,180,669.750	

	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,425	2,920.950	7,083,303.750	
	BANDHAN BANK LTD	38,990	316.750	12,350,082.500	
	ADANI TOTAL GAS LTD	16,897	917.150	15,497,083.550	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	27,249	519.300	14,150,405.700	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	12,184	974.500	11,873,308.000	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	12,556	844.100	10,598,519.600	
	ADANI TRANSMISSIONS LTD	16,803	1,000.500	16,811,401.500	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,810	3,377.600	29,756,656.000	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	11,517	1,568.600	18,065,566.200	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	19,044	613.350	11,680,637.400	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	4,893	1,809.300	8,852,904.900	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	24,046	1,019.600	24,517,301.600	
インド・ルピー	小計	5,026,543		3,694,565,115.350 (5,504,902,022)	
インドネシ ア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,590.000	1,480,703,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,470,900	890.000	1,309,101,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	84,801	19,500.000	1,653,619,500.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,475.000	2,285,027,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	480,500	4,890.000	2,349,645,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,306,700	4,910.000	6,415,897,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,139,900	3,160.000	9,922,084,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	386,800	6,325.000	2,446,510,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	41,150.000	1,333,260,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	67,800	10,650.000	722,070,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	7,200.000	1,373,760,000.000	
	BANK MANDIRI	1,183,100	5,775.000	6,832,402,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,422,100	3,800.000	13,003,980,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	344,300	4,640.000	1,597,552,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,005,700	1,320.000	1,327,524,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	149,800	8,900.000	1,333,220,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	616,700	30,100.000	18,562,670,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,250.000	1,167,625,000.000	

	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,550.000	1,410,750,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	3,240.000	1,727,892,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,718,300	1,325.000	2,276,747,500.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	425,600	2,980.000	1,268,288,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	18,583,201		81,800,328,000.000 (621,682,493)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	8,832	117.580	1,038,466.560	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,400	15.720	84,888.000	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	38.000	114,000.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	15.560	186,720.000	
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	1,800	151.710	273,078.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	7,540	23.010	173,495.400	
	WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	8.540	139,202.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	12.410	237,031.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	31.680	126,720.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	157.900	189,480.000	
	JOYOUNG CO LTD	5,100	30.830	157,233.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,400	35.080	575,312.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	7,500	23.800	178,500.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	900	381.520	343,368.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,330	23.750	245,337.500	
	YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	15.940	105,204.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	57.280	303,584.000	
	SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	17.870	105,433.000	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	19.930	380,663.000	
	HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	3.570	84,966.000	



SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	22.060	145,596.000	
GEM CO LTD	29,100	11.430	332,613.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	64.630	445,947.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	6.080	113,088.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	2,400	118.000	283,200.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	8,568	26.630	228,165.840	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	47.430	280,026.720	
ZHEJIANG NHU CO LTD	6,960	27.990	194,810.400	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	18.510	49,236.600	
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	81.220	219,294.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	22.220	146,652.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	51.550	175,270.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	40.180	204,918.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	15.550	23,325.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	14.330	37,258.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	74.000	340,400.000	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD	12,400	48.650	603,260.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	9.520	104,720.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	20.860	175,224.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	16,800	56.700	952,560.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	4,800	175.030	840,144.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	17.580	179,316.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	14.650	164,080.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	8.080	253,712.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	14.380	80,528.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	5.080	72,644.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	16.200	44,226.000	

SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	19.740	51,324.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	35.910	280,098.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	50,250	17.080	858,270.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	25.800	154,800.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	170.330	545,056.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	27.180	97,032.600	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	15.040	224,096.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	11.630	147,701.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	8.640	74,304.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	16,181	63.830	1,032,833.230	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	560	77.610	43,461.600	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	28.600	197,340.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	6.400	244,480.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	34.190	167,531.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	9.200	140,760.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	10.710	224,910.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	41.040	307,800.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	45.470	227,350.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	21.380	141,108.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	4,800	216.510	1,039,248.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	79.200	879,120.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	7.490	111,975.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	8.150	144,255.000	

TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	2,400	39.480	94,752.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	15.900	94,446.000	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,320	22.130	117,731.600	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	5.630	90,080.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	104.140	218,694.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	9.160	334,156.800	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	9.740	139,282.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	30,654	46.270	1,418,360.580	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	6.540	179,850.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	44,500	8.250	367,125.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	13.650	271,635.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	23,900	20.520	490,428.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	7.540	28,652.000	
IFLYTEK CO LTD	13,500	61.400	828,900.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.420	253,374.000	
GOERTEK INC	8,700	40.020	348,174.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.620	162,306.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	19,100	35.100	670,410.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	14,600	28.200	411,720.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	8.060	382,044.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.090	200,647.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	7.560	284,256.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	17,360	20.990	364,386.400	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	8.030	182,281.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	8,200	30.310	248,542.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,800	104.110	395,618.000	
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUTRY GROUP	10,700	24.860	266,002.000	

EAST MONEY INFORMATION CO LTD	33,408	31.490	1,052,017.920	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	4,800	185.100	888,480.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	14,000	267.280	3,741,920.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	7.250	150,800.000	
SUNING.COM CO LTD	23,700	6.220	147,414.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	125,600	6.310	792,536.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	65,300	11.290	737,237.000	
MIDEA GROUP CO LTD	14,100	69.200	975,720.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	10.540	179,180.000	
PING AN BANK CO LTD	61,400	21.270	1,305,978.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	53,580	13.970	748,512.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	180,400	4.500	811,800.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,300	24.060	993,678.000	
ZTE CORP	24,300	31.270	759,861.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	8.570	244,245.000	
WEICHAO POWER CO LTD	17,000	16.990	288,830.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	44.340	186,228.000	
GF SECURITIES CO LTD	52,200	14.270	744,894.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	12.320	259,952.000	
BYD CO LTD	7,700	248.820	1,915,914.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	9.140	311,674.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	30	113.850	3,415.500	
LB GROUP CO LTD	11,000	31.320	344,520.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	11.260	145,254.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	40.750	118,175.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	27.600	220,800.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,500	329.000	493,500.000	
JIANGXI ZHENGBO TECHNOLOGY CO LTD	3,600	11.400	41,040.000	

PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	20.540	113,997.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	222.990	267,588.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	12.750	198,900.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	50.380	332,508.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	60.500	36,300.000	
NINESTAR CORP	5,700	31.660	180,462.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	16.150	113,373.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	4.160	140,608.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	13.190	158,280.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	6,720	65.610	440,899.200	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	93.290	149,264.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	357.590	178,795.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	8.710	131,521.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	18.440	97,732.000	
SF HOLDING CO LTD	15,000	65.500	982,500.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	6.520	153,872.000	
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	6,500	45.040	292,760.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	7.560	482,252.400	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	29.240	397,664.000	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	7,000	64.920	454,440.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,940	159.250	468,195.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	16,400	24.910	408,524.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	134.260	416,206.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	12.080	271,800.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,560	46.900	73,164.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	34.880	181,376.000	

YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	83.530	263,119.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	249.070	821,931.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	116.200	313,740.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	76.500	237,150.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	132.500	278,250.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	6.450	152,220.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	135.990	587,476.800	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	14.780	140,410.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	36.340	109,020.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	23.100	180,180.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	108.900	91,476.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO- PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	60.200	162,540.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	2,080	57.900	120,432.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	81.800	108,794.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	112.000	145,600.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	76.060	228,180.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	2,000	139.500	279,000.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	10.160	129,032.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	12.870	347,490.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	135.410	257,279.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	9.880	96,824.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	11.950	172,080.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,600	444.410	2,044,286.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	18.400	97,520.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	9.200	142,600.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	252.720	303,264.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	97.740	396,824.400	

SG MICRO CORP	900	247.880	223,092.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	8,500	545.880	4,639,980.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,416	189.000	645,624.000	
WUXI APPTPEC CO LTD	10,872	150.780	1,639,280.160	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	3,500	99.790	349,265.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	600	485.800	291,480.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	36,300	13.570	492,591.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	3,300	200.650	662,145.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	99,079	5.600	554,842.400	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	329.150	1,250,770.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	129,100	3.950	509,945.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	2.420	197,714.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	174.110	156,699.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	173,700	5.250	911,925.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	4.760	512,652.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	79.860	487,146.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	800	119.490	95,592.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	198.000	118,800.000	
PETROCHINA CO LTD	110,900	4.990	553,391.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	4.850	1,027,230.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	3.030	831,432.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.070	257,880.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.200	176,820.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	32.160	321,600.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	15,500	19.980	309,690.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	73,900	49.900	3,687,610.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	42,100	60.090	2,529,789.000	

INDUSTRIAL BANK CO LTD	68,800	20.310	1,397,328.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	97,800	9.910	969,198.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	4.340	599,788.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	23,900	21.930	524,127.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,400	1,972.110	8,677,284.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.850	613,525.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	56,500	23.510	1,328,315.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	30,700	27.900	856,530.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.270	201,841.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	75,500	20.310	1,533,405.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	109,700	3.620	397,114.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	75,800	11.430	866,394.000	
HUAXIA BANK CO LTD	82,900	5.820	482,478.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	16,300	34.310	559,253.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.850	426,315.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	70,500	7.700	542,850.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,000	39.220	549,080.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	18.360	615,060.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	3.990	31,122.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	2,300	49.130	112,999.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	12.180	549,318.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	25,152	62.100	1,561,939.200	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	26,700	29.700	792,990.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	55,000	15.440	849,200.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	156,800	5.210	816,928.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,900	44.660	665,434.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,800	25.660	713,348.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	27,000	25.700	693,900.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	10,300	6.480	66,744.000	



SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	63.600	502,440.000	
GEMDALE CORP	10,600	10.070	106,742.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	22,100	32.360	715,156.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	10,300	124.650	1,283,895.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	92,700	10.140	939,978.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	68,500	8.940	612,390.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	9.740	307,784.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	30,120	25.300	762,036.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.400	131,120.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,300	265.160	1,935,668.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	600	96.650	57,990.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	25,000	3.850	96,250.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	95,100	5.860	557,286.000	
AIR CHINA LTD	28,400	7.550	214,420.000	
TBEA CO LTD	26,700	13.300	355,110.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	163,800	3.080	504,504.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	84,300	3.860	325,398.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	36,100	15.900	573,990.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	46.140	152,262.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	32.300	222,870.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	4.690	160,867.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	23.700	196,710.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	11.810	174,788.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	12.860	61,728.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	12.420	294,354.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	27,900	19.920	555,768.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	10.260	298,566.000	

JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	14.890	113,164.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	54,900	28.800	1,581,120.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	60,200	6.650	400,330.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	32,700	8.750	286,125.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	8.990	253,518.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	19.330	184,021.600	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	30.920	234,992.000	
BBMG CORP	54,200	2.580	139,836.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	4.690	137,886.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	14.650	272,490.000	
YUTONG BUS CO LTD	12,500	12.810	160,125.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	4.920	189,912.000	
LIAONING CHENG DA CO LTD	1,600	19.150	30,640.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	10.660	160,102.540	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	10.980	84,546.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	5,640	84.080	474,211.200	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	30.810	500,662.500	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	5.890	192,603.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.760	162,840.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	1,800	53.950	97,110.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	7.430	140,427.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.670	170,752.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	50.950	234,370.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	8.080	135,744.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	5.120	201,728.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	8.150	159,740.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	432.050	777,690.000	

TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	11.650	104,850.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	3,780	316.700	1,197,126.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	17.540	21,048.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	31,560	4.340	136,970.400	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	10.790	269,750.000	
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	25,900	7.200	186,480.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	3,100	57.290	177,599.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	10.460	236,396.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.920	102,704.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	39.590	213,786.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	9.970	125,622.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	6.260	187,800.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	40.000	168,000.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	20.380	118,815.400	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.730	150,214.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	24.500	110,250.000	
TONGWEI CO LTD	10,300	41.470	427,141.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,430	55.300	79,079.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	184.200	460,500.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	52.000	275,600.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	17.090	95,704.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	12,090	36.610	442,614.900	
CHINA JUSHI CO LTD	26,746	15.320	409,748.720	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	2,224	86.960	193,399.040	

TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	24.420	383,394.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	111.920	190,264.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	50.720	248,528.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	17,920	91.930	1,647,385.600	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	217.500	391,500.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	10.380	335,803.380	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	13,224	113.900	1,506,213.600	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	54.670	273,350.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	28.340	34,008.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	64.500	374,100.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	10.530	138,996.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	54,300	16.650	904,095.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	4.950	295,515.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	65.800	223,720.000	
HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	5.340	88,110.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	91,100	6.840	623,124.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	13.960	329,456.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	900	40.520	36,468.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,430	71.970	102,917.100	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	21.800	43,600.000	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	116.360	139,632.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	74.070	111,105.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	10.010	392,392.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	77,216	7.980	616,183.680	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	361.700	289,360.000	
TOLY BREAD CO LTD	5,040	29.040	146,361.600	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	50.180	143,514.800	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	58.140	170,931.600	

	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	9.570	185,658.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	4,200	54.800	230,160.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.880	254,080.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,000	79.520	477,120.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	29,200	5.360	156,512.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	40.680	435,276.000	
オフショア・人民元 小計		8,150,276		150,660,458.070 (2,561,242,853)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	250,492	17.800	4,458,757.600	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	90,299	5.440	491,226.560	
	OOREDOO QSC	40,049	7.260	290,755.740	
	QATAR FUEL QSC	28,478	17.750	505,484.500	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	24,605	16.750	412,133.750	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	9.301	474,611.420	
	INDUSTRIES QATAR QSC	90,288	13.430	1,212,567.840	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	75,819	17.060	1,293,472.140	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	138,961	3.193	443,702.470	
	MASRAF AL RAYAN	242,381	4.450	1,078,595.450	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.134	433,899.160	
	MESAI EED PETROCHEMICAL HOLDING CO	251,921	1.885	474,871.080	
カタール・リアル 小計		1,422,770		11,570,077.710 (347,449,434)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	254,684	0.754	192,031.730	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	126,248	0.584	73,728.830	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	418,385	0.857	358,555.940	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	58,560	0.941	55,104.960	
	MABANEE CO KPSC	53,293	0.716	38,157.780	
	BOUBYAN BANK KSCP	83,909	0.750	62,931.750	
クウェート・ディナール 小計		995,079		780,510.990 (286,627,051)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	23,125	23,350.000	539,968,750.000	
	ECOPETROL SA	281,230	2,761.000	776,476,030.000	
	BANCOLOMBIA SA	12,950	28,100.000	363,895,000.000	

	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,129	28,810.000	1,012,066,490.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	4,847	19,510.000	94,564,970.000	
コロンビア・ペソ 小計		357,281		2,786,971,240.000 (80,094,766)	
サウジアラビ ア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	15,478	67.800	1,049,408.400	
	JARIR MARKETING CO	4,004	203.000	812,812.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	79.000	328,245.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	18,500	31.100	575,350.000	
	SAUDI BRITISH BANK	44,520	29.900	1,331,148.000	
	AL RAJHI BANK	70,298	106.600	7,493,766.800	
	ARAB NATIONAL BANK	34,464	21.920	755,450.880	
	BANK ALBILAD	26,491	35.850	949,702.350	
	BANK AL-JAZIRA	35,440	18.400	652,096.000	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,102	37.500	1,391,325.000	
	RIYAD BANK	73,924	25.600	1,892,454.400	
	SAUDI TELECOM CO	36,286	126.800	4,601,064.800	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	12,050	119.800	1,443,590.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	50,439	116.800	5,891,275.200	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	63.700	412,584.900	
	SAUDI ELECTRICITY CO	45,963	24.720	1,136,205.360	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	18,628	35.350	658,499.800	
	SAVOLA GROUP	14,538	40.900	594,604.200	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	20.080	452,362.240	
	ALMARAI CO JSC	16,575	58.300	966,322.500	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	12.120	343,129.320	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	16,278	30.000	488,340.000	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	8,395	73.000	612,835.000	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	39,276	18.600	730,533.600	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	10.100	313,211.100	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	10,717	26.150	280,249.550	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	21,818	14.040	306,324.720	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,968	130.000	385,840.000		
ALINMA BANK	61,501	20.880	1,284,140.880		
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	3,516	118.000	414,888.000		

	SAUDI ARABIAN MINING CO	27,062	64.100	1,734,674.200	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	8,516	43.800	373,000.800	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,377	172.800	583,545.600	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	121,247	34.600	4,195,146.200	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	2,712	158.800	430,665.600	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	124,979	55.400	6,923,836.600	
サウジアラビア・リアル 小計		1,099,544		52,788,629.000 (1,553,041,465)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	105.000	2,908,500.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	36,300	33.750	1,225,125.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	103,600	10.200	1,056,720.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	34,200	44.000	1,504,800.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	43,200	92.000	3,974,400.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	509,355	3.040	1,548,439.200	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	12,400	169.000	2,095,600.000	
	SHIN CORP PCL	99,500	64.500	6,417,750.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	163,400	26.250	4,289,250.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	69,700	169.500	11,814,150.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	493,920	13.900	6,865,488.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	14,300	588.000	8,408,400.000	
	PTT PCL	578,800	37.250	21,560,300.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	147,100	22.100	3,250,910.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	32,500	66.250	2,153,125.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	722,300	7.900	5,706,170.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	47,350	420.000	19,887,000.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	259,800	60.250	15,652,950.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	93,800	50.750	4,760,350.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	510,600	24.000	12,254,400.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,800	126.500	5,034,700.000		
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	169,510	29.250	4,958,167.500		

	THAI OIL PCL NVDR	83,100	51.500	4,279,650.000	
	CP ALL PCL NVDR	356,700	60.250	21,491,175.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	356,100	8.800	3,133,680.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	70,645	113.000	7,982,885.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	69,922	39.500	2,761,919.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	147,408	58.500	8,623,368.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	76,000	59.250	4,503,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	645,000	7.950	5,127,750.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	40.500	2,292,300.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	196,900	33.250	6,546,925.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	120,500	37.500	4,518,750.000	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	17.700	1,863,810.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	353,600	4.000	1,414,400.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	91,933	33.500	3,079,755.500	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	90,400	61.750	5,582,200.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	30,300	68.750	2,083,125.000	
	SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	36,600	39.750	1,454,850.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	29.000	5,701,400.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	26,200	148.500	3,890,700.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	58.000	3,543,800.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	73.250	3,596,575.000	
	タイ・パーツ 小計	7,429,143		250,798,712.200 (845,191,660)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,704	772.000	4,403,488.000	
	CEZ	7,596	600.000	4,557,600.000	
	MONETA MONEY BANK AS	26,989	85.000	2,294,065.000	
チェコ・コルナ	小計	40,289		11,255,153.000 (57,176,177)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,631,383	35.330	128,296,761.390	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,773	30,850.000	85,547,050.000	
	BANCO DE CHILE	2,874,683	70.000	201,227,810.000	
	EMPRESAS CMPC SA	60,153	1,646.700	99,053,945.100	
	EMPRESAS COPEC SA	23,509	6,700.000	157,510,300.000	



	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,581	7,854.100	83,104,232.100	
	ENEL AMERICAS SA	835,617	107.900	90,163,074.300	
	COLBUN SA	580,423	102.100	59,261,188.300	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,180	35,950.000	294,071,000.000	
	FALABELLA SA	48,873	3,150.000	153,949,950.000	
	CENCOSUD SA	81,121	1,386.800	112,498,602.800	
	CENCOSUD SHOPPING SA	29,231	1,210.000	35,369,510.000	
	ENEL CHILE SA	1,469,615	39.550	58,123,273.250	
チリ・ペソ 小計		9,656,142		1,558,176,697.240 (229,324,655)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	238,837	5.320	1,270,612.840	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	14.800	664,490.400	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	96,186	18.050	1,736,157.300	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	174.400	814,099.200	
	KOC HOLDING AS	53,770	19.900	1,070,023.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	7.720	694,800.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	62,654	16.020	1,003,717.080	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	114,153	8.530	973,725.090	
	TURKIYE IS BANKASI	66,205	5.270	348,900.350	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	6,201	96.600	599,016.600	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	27,755	63.250	1,755,503.750	
トルコ・リラ 小計		805,327		10,931,045.610 (139,178,445)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	8,393	8,270.000	69,410,110.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	26,296	2,378.000	62,531,888.000	
	OTP BANK NYRT	13,167	16,185.000	213,107,895.000	
ハンガリー・フォロント 小計		47,856		345,049,893.000 (126,910,731)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	7,000	888.190	6,217,330.000	
	MCB BANK LTD	12,400	157.970	1,958,828.000	
	HABIB BANK LTD	19,300	128.680	2,483,524.000	
パキスタン・ルピー 小計		38,700		10,659,682.000 (7,461,777)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	425,500	36.000	15,318,000.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	94,330	41.500	3,914,695.000	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	107,520	88.400	9,504,768.000	
	AYALA CORP	17,253	784.000	13,526,352.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,420	1,965.000	2,790,300.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	46,120	160.000	7,379,200.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	199,650	60.400	12,058,860.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	14,940	203.000	3,032,820.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	61,575	47.450	2,921,733.750	
	BDO UNIBANK INC	125,723	111.500	14,018,114.500	
	PLDT INC	5,260	1,300.000	6,838,000.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	590,375	36.000	21,253,500.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	54,840	144.000	7,896,960.000	
	SM INVESTMENTS CORP	13,953	1,000.000	13,953,000.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	3.750	3,382,125.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	275.200	4,873,792.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	587.500	3,878,087.500	
	フィリピン・ペソ 小計	2,684,670		146,540,307.750 (322,432,639)	
ブラジル・リアル	BRF SA	29,692	26.300	780,899.600	
	VALE SA	230,721	113.660	26,223,748.860	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	79,000	5.950	470,050.000	
	RAIA DROGASIL SA	70,100	25.630	1,796,663.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	11,250	42.290	475,762.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	42.700	841,190.000	
	BANCO DO BRASIL SA	52,000	31.790	1,653,080.000	
	ITAUSA SA	272,560	11.170	3,044,495.200	
	LOJAS AMERICANAS SA	53,174	20.570	1,093,789.180	
	GERDAU SA	69,130	29.100	2,011,683.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	214,810	28.160	6,049,049.600	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	66,200	28.730	1,901,926.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	279,912	27.490	7,694,780.880	
	CCR SA	65,320	13.270	866,796.400	
	WEG SA	100,244	34.730	3,481,474.120	
	BANCO BRADESCO SA PREF	292,193	24.590	7,185,025.870	
	BANCO BRADESCO SA	78,457	20.760	1,628,767.320	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,106	44.090	1,856,453.540	
	BRADESPAR SA	10,200	75.950	774,690.000	
	SUZANO SA	45,075	60.980	2,748,673.500	
CPFL ENERGIA SA	20,700	26.500	548,550.000		

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	284,247	29.290	8,325,594.630	
	B2W CIA DIGITAL	9,400	65.920	619,648.000	
	BRASKEM SA	12,300	58.390	718,197.000	
	ENGIE BRASIL SA	16,587	39.180	649,878.660	
	ALPARGATAS SA	8,500	53.040	450,840.000	
	LOCALIZA RENT A CAR	36,389	65.510	2,383,843.390	
	LOJAS RENNER SA	57,237	44.570	2,551,053.090	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	37,904	19.060	722,450.240	
	COSAN SA	57,600	24.650	1,419,840.000	
	TOTVS SA	23,600	37.370	881,932.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	62,400	24.300	1,516,320.000	
	JBS SA	63,900	29.010	1,853,739.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	56,717	11.730	665,290.410	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	17,998	35.450	638,029.100	
	HYPERA SA	18,200	33.950	617,890.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	367,348	16.150	5,932,670.200	
	MAGAZINE LUIZA SA	177,700	21.920	3,895,184.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	32,628	41.650	1,358,956.200	
	VIA VAREJO S/A	68,300	14.850	1,014,255.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	42,300	22.600	955,980.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	31,600	83.780	2,647,448.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	59,100	15.000	886,500.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	20.770	621,023.000	
	AMBEV SA	277,195	17.360	4,812,105.200	
	NATURA &CO HOLDING SA	54,400	60.100	3,269,440.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA-RTS	46,756	0.010	467.560	
	TIM SA	25,700	11.240	288,868.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	14,800	70.600	1,044,880.000	
	RUMO SA	80,500	20.000	1,610,000.000	
	ブラジル・リアル 小計	4,173,750		125,479,871.250 (2,628,075,519)	
ポーランド・ズロチ	KGHM POLSKA MIEDZ SA	8,662	187.800	1,626,723.600	
	BANK PEKAO SA	9,730	92.260	897,689.800	
	ORANGE POLSKA SA	30,783	7.200	221,637.600	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	18,695	74.540	1,393,525.300	
	LPP SA	67	13,630.000	913,210.000	

	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,600	253.200	405,120.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,633	188.000	871,004.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	53,609	37.460	2,008,193.140	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	88,535	6.540	579,018.900	
	CYFROWY POLSAT SA	12,239	31.540	386,018.060	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	9.040	471,815.680	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	37,670	37.070	1,396,426.900	
	DINO POLSKA SA	2,109	292.000	615,828.000	
	ALLEGRO.EU SA	21,992	71.550	1,573,527.600	
	ポーランド・ズロチ 小計	342,516		13,359,738.580 (384,311,584)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	81,400	2.880	234,432.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	358,900	4.490	1,611,461.000	
	DIGI.COM BHD	235,300	4.240	997,672.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	89,720	5.720	513,198.400	
	RHB BANK BHD	83,480	5.250	438,270.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	7.770	246,309.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	262,700	3.820	1,003,514.000	
	GENTING BHD	107,200	4.830	517,776.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	25,256	17.820	450,061.920	
	HONG LEONG BANK BHD	34,908	18.660	651,383.280	
	IOI CORP BHD	190,813	3.720	709,824.360	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	22,600	19.820	447,932.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	26.100	302,760.000	
	MALAYAN BANKING BHD	254,375	8.130	2,068,068.750	
	MISC BHD	100,880	6.780	683,966.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	133.600	547,760.000	
	PPB GROUP BHD	46,260	18.340	848,408.400	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	18.800	419,240.000	
	PETRONAS GAS BHD	39,600	15.600	617,760.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	219,800	2.800	615,440.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	5.980	355,810.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	139,650	9.690	1,353,208.500	
	QL RESOURCES BHD	50,950	5.580	284,301.000	
	DIALOG GROUP BHD	233,944	2.870	671,419.280	
	PUBLIC BANK BHD(Local)	849,850	4.060	3,450,391.000	

	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	82,800	3.090	255,852.000	
	SUPERMAX CORP BHD	74,571	3.290	245,338.590	
	SIME DARBY BERHAD	139,500	2.200	306,900.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	107,200	7.110	762,192.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	170,100	3.780	642,978.000	
	MAXIS BHD	130,800	4.420	578,136.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	136,200	8.060	1,097,772.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	113,100	5.610	634,491.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	35,700	4.240	151,368.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	157,600	4.900	772,240.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	93,400	3.840	358,656.000	
マレーシア・リンギット 小計		4,797,757		25,846,290.880 (680,452,715)	
メキシコ・ペソ	GRUPO BIMBO SAB DE CV	85,000	45.130	3,836,050.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,615	220.290	2,338,378.350	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,860	156.670	2,798,126.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	62.860	2,193,814.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	154,000	127.520	19,638,080.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	53,025	53.330	2,827,823.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,635	276.960	2,114,589.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	86,300	34.300	2,960,090.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,040	372.920	4,489,956.800	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	184,252	91.730	16,901,435.960	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,954,178	14.780	28,882,750.840	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	96,600	19.990	1,931,034.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	23,100	117.800	2,721,180.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	307,300	63.190	19,418,287.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	24,410	219.760	5,364,341.600	
	TELESITES SAB DE CV	77,300	18.110	1,399,903.000	
BECLÉ SAB DE CV	38,400	52.110	2,001,024.000		
メキシコ・ペソ 小計		3,166,915		121,816,864.600 (675,084,700)	
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,162	14.635	192,625.870	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	

	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	181,940	0.824	149,918.560	
	OPAP SA	11,246	12.460	140,125.160	
	JUMBO SA	3,560	14.200	50,552.000	
ユーロ 小計		213,038		533,221.590 (69,756,048)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,472	160,000.000	235,520,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,774	24,450.000	43,374,300.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,068	109,500.000	226,446,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,915	209,500.000	401,192,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	1,858	53,500.000	99,403,000.000	
	COWAY CO LTD	3,621	76,100.000	275,558,100.000	
	KT&G CORP	7,210	82,200.000	592,662,000.000	
	S-1 CORPORATION	794	81,400.000	64,631,600.000	
	CJ CORP	1,001	98,400.000	98,498,400.000	
	KAKAO CORP	18,304	160,500.000	2,937,792,000.000	
	CJ ENM CO LTD	299	179,800.000	53,760,200.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,497	32,700.000	81,651,900.000	
	KMW CO LTD	1,334	50,600.000	67,500,400.000	
	SK TELECOM CO LTD	2,372	322,000.000	763,784,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	11,262	9,030.000	101,695,860.000	
	NCSOFT CORPORATION	993	800,000.000	794,400,000.000	
	LG UPLUS CORP	14,606	14,600.000	213,247,600.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	8,781	26,100.000	229,184,100.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	566	1,720,000.000	973,520,000.000	
	LG CHEM LTD	2,677	833,000.000	2,229,941,000.000	
	LG CHEM LTD	499	373,000.000	186,127,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	102	794,000.000	80,988,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	26,101	38,200.000	997,058,200.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	15,510	44,650.000	692,521,500.000	
	S-OIL CORP	2,460	102,000.000	250,920,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	6,526	42,900.000	279,965,400.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	4,650.000	94,171,800.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,368	42,850.000	101,468,800.000	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,996	158,500.000	316,366,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,117	253,000.000	282,601,000.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	1,675	92,700.000	155,272,500.000	

KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,505	124,500.000	311,872,500.000	
HYUNDAI MOBIS	3,978	276,500.000	1,099,917,000.000	
SK HYNIX INC	32,124	119,500.000	3,838,818,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,534	57,100.000	258,891,400.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	110,500.000	167,407,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	8,132	226,000.000	1,837,832,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	4,533	51,600.000	233,902,800.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,371	10,050.000	184,628,550.000	
KIA CORPORATION	15,661	86,000.000	1,346,846,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	465	426,500.000	198,322,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	15,823	24,300.000	384,498,900.000	
KOREAN AIR CO LTD	10,084	30,300.000	305,545,200.000	
CJ LOGISTICS	451	181,500.000	81,856,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,199	216,000.000	258,984,000.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,020	93,000.000	94,860,000.000	
HLB INC	4,888	33,850.000	165,458,800.000	
LG ELECTRONICS INC	6,395	159,000.000	1,016,805,000.000	
LG CORP	4,786	97,100.000	464,720,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	12,300.000	112,704,900.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,631	42,050.000	194,733,550.000	
NAVER CORP	7,239	415,500.000	3,007,804,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,241	95,200.000	213,343,200.000	
AMOREPACIFIC GROUP	1,094	60,800.000	66,515,200.000	
KANGWON LAND INC	3,615	25,450.000	92,001,750.000	
POSCO	4,393	338,000.000	1,484,834,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,811	23,000.000	202,653,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,244	736,000.000	2,387,584,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,503	182,000.000	637,546,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	321,500.000	131,815,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	279,951	79,400.000	22,228,109,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	26,770	6,550.000	175,343,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	47,221	72,200.000	3,409,356,200.000	
SHINSEGAE CO LTD	272	272,000.000	73,984,000.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,563	67,100.000	104,877,300.000	
YUHAN CORP	4,055	61,800.000	250,599,000.000	

HANON SYSTEMS	10,146	15,950.000	161,828,700.000	
GS HOLDINGS CORP	2,879	44,050.000	126,819,950.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,712	23,050.000	339,111,600.000	
CELLTRION INC	5,715	262,000.000	1,497,330,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	18,154	42,500.000	771,545,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,132	199,000.000	225,268,000.000	
CELLTRION PHARM INC	988	160,600.000	158,672,800.000	
LOTTE SHOPPING CO	538	108,000.000	58,104,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,275	75,600.000	323,190,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	1,954	239,500.000	467,983,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,022	272,000.000	821,984,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	466	442,500.000	206,205,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	9,792	7,940.000	77,748,480.000	
LG INNOTEK CO LTD	764	227,500.000	173,810,000.000	
SK INC	1,893	270,000.000	511,110,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	23,443	50,400.000	1,181,527,200.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,664	33,750.000	123,660,000.000	
HANMI PHARM CO LTD	287	339,000.000	97,293,000.000	
FILA HOLDINGS CORP	2,517	53,000.000	133,401,000.000	
SEEGENE INC	1,958	88,000.000	172,304,000.000	
E-MART CO LTD	1,007	152,000.000	153,064,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	3,856	49,800.000	192,028,800.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	2,305	66,600.000	153,513,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	344	163,000.000	56,072,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,760	117,000.000	205,920,000.000	
SK CHEMICALS CO LTD	409	247,000.000	101,023,000.000	
NETMARBLE CORP	901	133,500.000	120,283,500.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	32,854	11,150.000	366,322,100.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,169	128,000.000	149,632,000.000	
HYBE CO LTD	620	308,000.000	190,960,000.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,198	182,000.000	400,036,000.000	
ALTEOGEN INC	1,059	93,300.000	98,804,700.000	
SAMSUNG C&T CORP	5,017	128,000.000	642,176,000.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	991	857,000.000	849,287,000.000	
PEARL ABYSS CORP	2,080	80,300.000	167,024,000.000	
DOOSAN BOBCAT INC	2,922	48,600.000	142,009,200.000	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,096	111,000.000	565,656,000.000	
韓国・ウォン 小計	881,537		73,128,901,940.000 (7,035,000,367)	



香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	16.180	1,084,060.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	8.550	769,500.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	48,000	4.670	224,160.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	107.820	690,048.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	74,000	38.350	2,837,900.000	
	BEIJING ENTERPRISES	21,500	25.450	547,175.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	180,000	2.650	477,000.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	244,000	15.160	3,699,040.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	10.400	728,000.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	27,400	34.600	948,040.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	43,500	52.050	2,264,175.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	7.300	1,036,600.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	543,600	10.160	5,522,976.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	229,120	17.720	4,060,006.400	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	188,888	30.800	5,817,750.400	
	CITIC LTD	351,000	8.230	2,888,730.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	96,000	4.950	475,200.000	
	LENOVO GROUP LTD	442,000	8.930	3,947,060.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,166,000	3.490	4,069,340.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	110,590	11.940	1,320,444.600	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,453,200	3.710	5,391,372.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	49,000	15.000	735,000.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	161,000	24.900	4,008,900.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	47,100	147.100	6,928,410.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	208,000	6.780	1,410,240.000	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	62,000	6.190	383,780.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	63,200	8.020	506,864.000		
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	110,000	11.480	1,262,800.000		
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	4.670	681,820.000		

(THE) WHARF HOLDINGS LTD	87,000	29.200	2,540,400.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	96,500	10.540	1,017,110.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	44,000	8.860	389,840.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	184,800	23.350	4,315,080.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	44,500	39.950	1,777,775.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	356,000	23.650	8,419,400.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	216,000	2.310	498,960.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	56,000	45.650	2,556,400.000	
BYD CO LTD	45,000	216.200	9,729,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	6.300	743,400.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	540,000	1.000	540,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	281,592	4.150	1,168,606.800	
MMG LTD	184,000	3.590	660,560.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	6.500	455,000.000	
CHINA YOUZAN LTD	580,000	1.340	777,200.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	417,788	6.940	2,899,448.720	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	4.970	670,950.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	91,200	10.480	955,776.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	196,000	27.500	5,390,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	424,000	13.920	5,902,080.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	329,000	10.620	3,493,980.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	156,000	16.800	2,620,800.000	
WEICHAI POWER CO LTD	127,440	16.440	2,095,113.600	
TINGYI HOLDING CORP	106,000	15.400	1,632,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	28,000	73.850	2,067,800.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	188,000	10.640	2,000,320.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	238,000	4.920	1,170,960.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	87,333	63.150	5,515,078.950	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	68,000	6.890	468,520.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	633,250	6.950	4,401,087.500	

CHINA MENGNIU DAIRY CO	165,000	44.550	7,350,750.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	337,000	538.500	181,474,500.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	363,500	71.250	25,899,375.000	
LI NING CO LTD	134,000	91.700	12,287,800.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	260,000	2.950	767,000.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	689,240	0.950	654,778.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	439,000	1.700	746,300.000	
AIR CHINA / HONG KONG	76,000	5.470	415,720.000	
ZTE CORP	44,288	21.900	969,907.200	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	206,000	14.920	3,073,520.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	165,750	14.500	2,403,375.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	414,205	4.620	1,913,627.100	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	110,250	4.990	550,147.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	41,500	53.200	2,207,800.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	5,603,530	5.550	31,099,591.500	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	49,100	181.600	8,916,560.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	140,000	6.970	975,800.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	44,000	9.590	421,960.000	
MINTH GROUP LTD	32,000	33.850	1,083,200.000	
SSY GROUP LTD	28,000	7.130	199,640.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	84,000	10.880	913,920.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	242,000	8.840	2,139,280.000	
BANK OF CHINA LTD	4,475,200	2.740	12,262,048.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	67,500	17.920	1,209,600.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	11.440	686,400.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	99,200	8.390	832,288.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	226,970	61.550	13,970,003.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,276,235	4.500	14,743,057.500	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	49,500	7.370	364,815.000	

KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	16.180	865,630.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.500	586,600.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	33,000	25.350	836,550.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	31,300	47.900	1,499,270.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	453,142	8.210	3,720,295.820	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	237,000	5.770	1,367,490.000	
CHINA CITIC BANK-H	417,800	3.630	1,516,614.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	65,000	10.200	663,000.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	43,400	230.200	9,990,680.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	64,000	185.400	11,865,600.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	22.700	454,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	169,028	10.980	1,855,927.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	300,000	2.480	744,000.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	6.280	533,800.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	162,000	5.320	861,840.000	
KINGSOFT CORP LTD	60,000	41.600	2,496,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	35,000	13.960	488,600.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	168,000	3.920	658,560.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	111,000	8.380	930,180.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	29,000	45.350	1,315,150.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	320,000	5.390	1,724,800.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	150,800	23.050	3,475,940.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	110,000	9.470	1,041,700.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	92,000	18.340	1,687,280.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	83,500	5.430	453,405.000	
SINOPHARM GROUP CO	86,000	21.850	1,879,100.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	112,000	7.040	788,480.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	178,527	7.690	1,372,872.630	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	10.620	1,598,310.000	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	108,000	6.650	718,200.000	

CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	198,000	3.010	595,980.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	210,000	13.240	2,780,400.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	30,100	15.520	467,152.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	155,000	24.150	3,743,250.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	61,200	7.730	473,076.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	90,000	7.830	704,700.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	106,500	40.950	4,361,175.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	43,100	23.450	1,010,695.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	364,656	3.710	1,352,873.760	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	125,000	2.590	323,750.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	31,000	12.100	375,100.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	44,000	17.500	770,000.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.830	707,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,447,000	2.650	3,834,550.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	30,000	75.450	2,263,500.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	8.070	831,210.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	33,000	63.900	2,108,700.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	109,000	17.460	1,903,140.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	118,000	7.110	838,980.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	93,600	6.700	627,120.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	461,000	2.540	1,170,940.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	25,500	54.750	1,396,125.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	226,000	5.750	1,299,500.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	106,500	4.220	449,430.000	

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	72,000	9.260	666,720.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	438,000	5.080	2,225,040.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	26,000	51.750	1,345,500.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	68,000	34.750	2,363,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	88,000	76.000	6,688,000.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	4.330	398,360.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	22,600	83.850	1,895,010.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	16.800	873,600.000	
PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LTD	55,000	1.750	96,250.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	13.720	514,500.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	23,750	33.100	786,125.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,594,000	1.060	2,749,640.000	
XIAOMI CORP	845,400	26.700	22,572,180.000	
WUXI APPTec CO LTD	18,912	170.800	3,230,169.600	
WEIMOB INC	105,000	14.760	1,549,800.000	
MEITUAN	212,000	279.200	59,190,400.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	44,400	18.520	822,288.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	67,000	44.150	2,958,050.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	298,000	15.580	4,642,840.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	70,000	82.300	5,761,000.000	
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES GROUP LTD	42,000	17.640	740,880.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	665,000	1.460	970,900.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	24,000	42.150	1,011,600.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	10.040	1,034,120.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	31.150	3,192,875.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	48.400	280,720.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	78,000	16.580	1,293,240.000	

CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	27,000	10.660	287,820.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	4,000	327.200	1,308,800.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	62,000	11.400	706,800.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	66,000	31.050	2,049,300.000	
CHINA FEIHE LTD	215,000	15.600	3,354,000.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	887,568	195.500	173,519,544.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,700	181.600	1,398,320.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	72,000	41.500	2,988,000.000	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,500	61.100	947,050.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	31.150	1,557,500.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	16,200	152.800	2,475,360.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	113,200	27.050	3,062,060.000	
AKESO INC	20,000	57.000	1,140,000.000	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	42,000	26.700	1,121,400.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	25,000	37.300	932,500.000	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	25.200	1,033,200.000	
NONGFU SPRING CO LTD	19,000	39.050	741,950.000	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	72,000	2.820	203,040.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	12,750	98.450	1,255,237.500	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	23,000	46.600	1,071,800.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	4,600	156.300	718,980.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	92,661	24.350	2,256,295.350	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	28,000	40.350	1,129,800.000	
CGN POWER CO LTD	450,000	1.700	765,000.000	
GF SECURITIES CO LTD	68,200	9.800	668,360.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	47,600	51.100	2,432,360.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	48,400	10.720	518,848.000	
3SBIO INC	90,500	8.270	748,435.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	4.520	424,880.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	461,000	1.020	470,220.000	

	CHINA LITERATURE LTD	28,400	80.650	2,290,460.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	34,000	31.650	1,076,100.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.620	676,830.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	6.510	416,640.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	7.750	503,750.000	
	BOC AVIATION LTD	10,700	62.900	673,030.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	34,000	41.350	1,405,900.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	54,000	17.120	924,480.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	68,800	20.050	1,379,440.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	199,000	134.400	26,745,600.000	
	HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	176,000	5.490	966,240.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	13,400	132.500	1,775,500.000	
香港・ドル	小計	50,677,663		944,474,560.370 (13,392,649,263)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	31,000	331.000	10,261,000.000	
	ACER INC	202,532	28.550	5,782,288.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	42,554	373.000	15,872,642.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,616	515.000	14,737,240.000	
	ASIA CEMENT CORP	145,928	52.800	7,704,998.400	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	19,000	211.000	4,009,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	469,267	9.480	4,448,651.160	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	62,000	113.500	7,037,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	38,000	154.500	5,871,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	74,000	142.500	10,545,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	160,858	90.500	14,557,649.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	43,760	181.500	7,942,440.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	244,761	16.200	3,965,128.200	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	84,169	44.700	3,762,354.300	
	CHINA STEEL CORP	707,058	38.050	26,903,556.900	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	88,973	26.900	2,393,373.700	
	ADVANTECH CO LTD	20,675	348.000	7,194,900.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	213,304	22.100	4,714,018.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	113,663	295.000	33,530,585.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	52,000	78.600	4,087,200.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	204,427	114.500	23,406,891.500	



AU OPTRONICS CORP	537,194	22.250	11,952,566.500	
TAIWAN MOBILE CO LTD	90,800	103.000	9,352,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	155,820	187.000	29,138,340.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	168,824	32.950	5,562,750.800	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,768	238.000	5,180,784.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	11,322	630.000	7,132,860.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	35,285	492.500	17,377,862.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	227,633	103.500	23,560,015.500	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	209,594	85.100	17,836,449.400	
GIANT MANUFACTURING	16,151	296.000	4,780,696.000	
MEDIATEK INC	88,507	919.000	81,337,933.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	392,936	74.200	29,155,851.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	466,944	18.650	8,708,505.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	14,000	591.000	8,274,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	89,000	65.400	5,820,600.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	585,146	25.550	14,950,480.300	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	460,941	53.800	24,798,625.800	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	882,403	13.700	12,088,921.100	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	652,448	26.200	17,094,137.600	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	729,225	114.000	83,131,650.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	621,495	32.900	20,447,185.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	2,990.000	18,597,800.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	528,058	16.100	8,501,733.800	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	733,061	9.630	7,059,377.430	
INVENTEC CO LTD	120,005	27.500	3,300,137.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	140,845	57.500	8,098,587.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	553,443	13.950	7,720,529.850	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,072,048	22.700	24,335,489.600	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	596,977	22.650	13,521,529.050	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,560	110.500	4,150,380.000	

NAN YA PLASTICS CORP	301,828	86.300	26,047,756.400	
WISTRON CORP	157,916	32.700	5,163,853.200	
POU CHEN CORP	157,990	38.750	6,122,112.500	
UNI -PRESIDENT ENTERPRISES CORP	279,297	73.800	20,612,118.600	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	35,392	260.500	9,219,616.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	64,480	110.000	7,092,800.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	6,658	482.000	3,209,156.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,589	62.900	2,930,448.100	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	43,588	65.000	2,833,220.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	62,899	52.600	3,308,487.400	
TAIWAN CEMENT CORP	307,171	52.000	15,972,892.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,441,083	584.000	841,592,472.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	705,525	52.200	36,828,405.000	
WAN HAI LINES LTD	35,000	275.000	9,625,000.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	180,000	35.300	6,354,000.000	
YAGEO CORP	22,160	584.000	12,941,440.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	94,000	195.500	18,377,000.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	79,000	29.850	2,358,150.000	
INNOLUX CORPORATION	536,345	20.700	11,102,341.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	118,203	55.400	6,548,446.200	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	14,000	418.000	5,852,000.000	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	16,475	380.500	6,268,737.500	
PEGATRON CORP	103,554	67.600	7,000,250.400	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	8,000	1,080.000	8,640,000.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	15,000	370.000	5,550,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	73,470	208.500	15,318,495.000	
ONENESS BIOTECH CO LTD	9,000	207.500	1,867,500.000	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,445.000	2,890,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	29,385	105.000	3,085,425.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	540,954	21.500	11,630,511.000	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	217,993	44.950	9,798,785.350	
WIWYNN CORP	4,000	1,045.000	4,180,000.000	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	196,903	111.000	21,856,233.000	

	SILERGY CORP	5,000	3,750.000	18,750,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	12,000	886.000	10,632,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	414.500	2,901,500.000	
台湾・ドル	小計	19,222,056		1,936,156,248.840 (7,606,189,824)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	265.300	1,900,343.900	
	BIDVEST GROUP LTD	16,200	191.690	3,105,378.000	
	CLICKS GROUP LTD	16,368	257.350	4,212,304.800	
	DISCOVERY LTD	21,137	124.720	2,636,206.640	
	GOLD FIELDS LTD	52,869	129.320	6,837,019.080	
	REMGRO LTD	26,000	115.350	2,999,100.000	
	NORTHAM PLATINUM LTD	22,064	217.150	4,791,197.600	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	28,537	53.950	1,539,571.150	
	EXXARO RESOURCES LTD	14,115	177.570	2,506,400.550	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,906	1,630.080	7,997,172.480	
	MTN GROUP LTD	100,234	105.470	10,571,679.980	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	24,940	277.640	6,924,341.600	
	FIRSTRAND LTD	300,251	56.030	16,823,063.530	
	NASPERS LTD	25,534	2,735.450	69,846,980.300	
	NEDBANK GROUP LTD	15,999	174.490	2,791,665.510	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,205	1,675.630	5,370,394.150	
	SASOL LTD	33,596	222.500	7,475,110.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	31,242	157.870	4,932,174.540	
	MR PRICE GROUP LTD	17,459	212.880	3,716,671.920	
	STANDARD BANK GROUP LTD	78,636	133.210	10,475,101.560	
	SPAR GROUP LTD/THE	9,414	182.520	1,718,243.280	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	54,219	55.110	2,988,009.090	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	25,010	168.050	4,202,930.500	
	ABSA GROUP LTD	39,186	139.180	5,453,907.480	
	TIGER BRANDS LTD	6,370	204.000	1,299,480.000	
	SANLAM LTD	117,098	60.250	7,055,154.500	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	47,214	235.470	11,117,480.580	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,173	691.700	2,194,764.100	
	RMI HOLDINGS	35,836	31.120	1,115,216.320	
	VODACOM GROUP PTY LTD	38,342	127.310	4,881,320.020	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	22,185	105.000	2,329,425.000	
	OLD MUTUAL LTD	304,247	13.170	4,006,932.990	
	REINET INVESTMENTS SCA	7,743	277.930	2,152,011.990	
	MULTICHOICE GROUP LTD	19,199	112.750	2,164,687.250	
	SIBANYE STILLWATER LTD	167,996	59.640	10,019,281.440	
	BID CORP LTD	20,642	322.500	6,657,045.000	
南アフリカ・ランド	小計	1,758,329		246,807,766.830	

			(1,905,355,960)	
合計	144,914,328		52,826,219,697 (52,826,219,697)	

## (2) 株式以外の有価証券

2021年7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	66,800.000	2,032,724.000		
		BANCO INTER SA	19,500.000	1,481,415.000		
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	21,700.000	863,660.000		
		ENERGISA SA	15,800.000	712,580.000		
		KLABIN SA	31,400.000	847,800.000		
	ブラジル・リアル 小計			155,200.000	5,938,179.000 (124,370,409)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	906,975.000	15,155,552.250		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	35,200.000	3,668,192.000		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	114,700.000	19,025,289.000		
		GRUPO TELEVISIA SAB	157,800.000	8,506,998.000		
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	6,900.000	495,765.000		
	メキシコ・ペソ 小計			1,221,575.000	46,851,796.250 (259,643,285)	
	投資信託受益証券 合計			1,376,775	384,013,694 (384,013,694)	
	投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	173,900.000	3,752,762.000	
		メキシコ・ペソ 小計		173,900.000	3,752,762.000 (20,797,056)	
南アフリカ・ランド		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	235,102.000	3,702,856.500		
南アフリカ・ランド 小計		235,102.000	3,702,856.500 (28,586,052)			
投資証券 合計			409,002	49,383,108 (49,383,108)		
合計				433,396,802 (433,396,802)		

(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	74銘柄	8.94	-	-	10.00
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式	9銘柄	0.65	-	-	0.72
イギリス・ポンド	株式	1銘柄	0.09	-	-	0.10
インド・ルピー	株式	101銘柄	9.24	-	-	10.34
インドネシア・ルピア	株式	22銘柄	1.04	-	-	1.17
オフショア・人民元	株式	346銘柄	4.30	-	-	4.81
カタール・リアル	株式	12銘柄	0.58	-	-	0.65
クウェート・ディナール	株式	6銘柄	0.48	-	-	0.54
コロンビア・ペソ	株式	5銘柄	0.13	-	-	0.15
サウジアラビア・リアル	株式	36銘柄	2.61	-	-	2.92
タイ・バーツ	株式	43銘柄	1.42	-	-	1.59
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.10	-	-	0.11
チリ・ペソ	株式	13銘柄	0.38	-	-	0.43
トルコ・リラ	株式	11銘柄	0.23	-	-	0.26
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.21	-	-	0.24
パキスタン・ルピー	株式	3銘柄	0.01	-	-	0.01
フィリピン・ペソ	株式	17銘柄	0.54	-	-	0.61
ブラジル・レアル	株式	50銘柄	4.41	-	-	5.17
	投資信託受益証券	5銘柄	-	0.21	-	
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.64	-	-	0.72
マレーシア・リンギット	株式	36銘柄	1.14	-	-	1.28
メキシコ・ペソ	株式	17銘柄	1.13	-	-	1.79
	投資信託受益証券	5銘柄	-	0.44	-	
	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	
ユーロ	株式	5銘柄	0.12	-	-	0.13
韓国・ウォン	株式	103銘柄	11.80	-	-	13.21
香港・ドル	株式	213銘柄	22.47	-	-	25.15
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.76	-	-	14.28
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.20	-	-	3.63
	投資証券	1銘柄	-	-	0.05	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## DIAMマネーマザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年7月12日現在

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		378,216,206
国債証券		410,577,400
特殊債券		254,437,520
未収利息		941,375
前払費用		17,260
流動資産合計		1,044,189,761
資産合計		1,044,189,761
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本		1,035,978,459
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		8,211,302
元本等合計		1,044,189,761
純資産合計		1,044,189,761
負債純資産合計		1,044,189,761

## 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1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 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	2021年7月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,056,034,563円
同期中追加設定元本額	- 円
同期中一部解約元本額	20,056,104円
元本の内訳	
ファンド名	
クルーズコントロール	990,000,991円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>	10,530,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5,972円
U Sストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジあり）	993,740円
U Sストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	1,987,479円
D I A M - ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<D C年金>	9,935円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）円コース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）米ドルコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）豪ドルコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）メキシコペソコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）トルコリラコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）ブラジルリアルコース	9,925円
U Sストラテジック・インカム・ファンド（年1回決算型）為替ヘッジあり	9,924円
U Sストラテジック・インカム・ファンド（年1回決算型）為替ヘッジなし	9,924円
マシューズ・アジア株式ファンド	29,641,137円
One世界分散セレクト（Aコース）	99,040円
One世界分散セレクト（Bコース）	99,040円
One世界分散セレクト（Cコース）	99,040円

世界8資産リスク分散バランスファンド(目標払出し型)	99,109円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(毎月決算型) (為替ヘッジあり)	188,380円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(毎月決算型) (為替ヘッジなし)	109,063円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(年1回決算型) (為替ヘッジあり)	297,442円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(年1回決算型) (為替ヘッジなし)	118,977円
計	1,035,978,459円
2. 受益権の総数	1,035,978,459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1月13日 至 2021年7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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る場合、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	2021年7月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		94,500
特殊債券		687,340
合計		781,840

(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(2021年4月6日から2021年7月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

		2021年7月12日現在
1口当たり純資産額		1.0079円
(1万口当たり純資産額)		(10,079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

2021年7月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	407回 利付国庫債券(2年)	200,000,000	200,170,000	
	413回 利付国庫債券(2年)	210,000,000	210,407,400	
国債証券 合計		410,000,000	410,577,400	
特殊債券	147回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,302,000	
	27回 政保地方公共団体金融機構債券	154,000,000	154,135,520	
特殊債券 合計		254,000,000	254,437,520	
合計			665,014,920	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年7月30日現在

資産総額	13,564,791,174円
負債総額	57,283,083円
純資産総額( - )	13,507,508,091円
発行済数量	10,353,897,701口
1口当たり純資産額( / )	1.3046円

(参考)

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	506,198,291,616円
負債総額	1,399,333,000円
純資産総額( - )	504,798,958,616円
発行済数量	384,611,486,906口
1口当たり純資産額( / )	1.3125円

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	392,193,140,759円
負債総額	1,361,600,340円
純資産総額( - )	390,831,540,419円
発行済数量	125,380,953,255口
1口当たり純資産額( / )	3.1172円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	146,152,098,738円
負債総額	66,664,000円
純資産総額( - )	146,085,434,738円
発行済数量	70,971,086,313口
1口当たり純資産額( / )	2.0584円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	589,661,162,872円
負債総額	84,312,984円
純資産総額( - )	589,576,849,888円
発行済数量	107,610,515,657口
1口当たり純資産額( / )	5.4788円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	156,332,448,476円
負債総額	1,598,323,000円
純資産総額( - )	154,734,125,476円
発行済数量	71,409,978,928口
1口当たり純資産額( / )	2.1668円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	60,446,712,188円
負債総額	371,896,713円
純資産総額( - )	60,074,815,475円
発行済数量	41,549,211,829口
1口当たり純資産額( / )	1.4459円

## DIAMマネーマザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	1,044,176,988円
負債総額	0円
純資産総額( - )	1,044,176,988円
発行済数量	1,035,978,459口
1口当たり純資産額( / )	1.0079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（2021年7月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2021年7月30日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年7月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,421,929,893,732
追加型株式投資信託	834	15,898,581,758,577
単位型公社債投資信託	29	61,675,044,716
単位型株式投資信託	215	1,335,566,478,953
合計	1,104	18,717,753,175,978

### 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、千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36期事業年度(自2020年4月1日至2021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：千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

(単位:千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		-	
為替差益	-		7,314	
金銭の信託運用益	-		1,229,697	
受取負担金	297,886		-	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		-	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		-	
システム解約料	31,680		-	
早期割増退職金	-		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		-	
特別利益計		1,169,758		-
特別損失				
固定資産除却損	1 16,085		1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		385,835		1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	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	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

	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	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	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	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

## 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 時価のあるもの：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） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 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。

(未適用の会計基準等)

## 1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「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 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

国際会計基準審議会( IASB )及び米国財務会計基準審議会( FASB )は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」( IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606 )を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

### (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「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 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「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 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

国際会計基準審議会( IASB )及び米国財務会計基準審議会( FASB )が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準( IFRS )においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

### (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。



**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

## 第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
2021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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

有価証券及び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。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

第35期(2020年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

第36期(2021年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	5,299,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (注3) 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35期(2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

## 第36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

## 2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

## 第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	996	-	3

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

## （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

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	4,319
退職給付の支払額	187,749	245,143
過去勤務費用の発生額	-	1,567
その他	1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

## (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

(千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	130,155	84,264
未認識過去勤務費用	173,798	102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	11,303	7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 3.76%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。



## (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35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

## (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	76,224,837千円
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	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(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	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円

(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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

## (2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85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	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,149,555千円	5,016,672千円

(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。

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

## 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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	15,005,011千円	14,125,803千円
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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
該当事項はありません。
- (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

## a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

## b. 資本金の額

2021年3月末日現在 247,369百万円

## c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社東北銀行	13,233	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行(1)	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社群馬銀行	48,652	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山銀行	6,730	日本において銀行業務を営んでおります。
スルガ銀行株式会社	30,043	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社紀陽銀行	80,096	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社伊予銀行	20,948	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十八親和銀行	36,800	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社肥後銀行	18,128	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社鹿児島銀行	18,130	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社きらやか銀行	24,200	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社仙台銀行	22,735	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東和銀行	38,653	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社神奈川銀行	6,191	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	(2) 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
アイザワ証券株式会社	(3) 3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
auカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
池田泉州TT証券株式会社	1,250	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
四国アライアンス証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
OKB証券株式会社	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

岡三オンライン証券株式会社	2,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
九州FG証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ぐんぎん証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
静岡東海証券株式会社	600	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社(1)	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
十六TT証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	(4)7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東海東京証券株式会社	6,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
とうほう証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
内藤証券株式会社	3,002	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社証券ジャパン	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
野村證券株式会社(1)	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ひろぎん証券株式会社	5,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
フィデリティ証券株式会社	10,858	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ほくほくTT証券株式会社	1,250	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ワイエム証券株式会社	1,270	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

(1) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

(2) 出資の総額

(3) 2021年10月1日現在

(4) 2020年12月31日現在

### (3) 投資顧問会社

#### a. 名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

#### b. 資本金の額

2021年3月末日現在 200百万円

#### c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【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

2021年5月26日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

## 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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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2021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。

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

---

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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

2021年8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 丘本正彦 印  
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」に掲げられているクルーズコントロールの2021年1月13日から2021年7月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、クルーズコントロールの2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。