

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年3月11日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ワールドアセットバランス（基本コース） ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）
【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】	ワールドアセットバランス（基本コース） 1兆円を上限とします。 ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ワールドアセットバランス（基本コース）

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

（以下、総称して「ワールドアセットバランス」、「ワールドアセットバランス（基本コース）／（リスク抑制コース）」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「ワールドアセットバランス（基本コース）」は「（基本コース）」、「ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）」は「（リスク抑制コース）」という場合があります。

各ファンドを総称した愛称として「ワールドOne」という名称を用いる場合があります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・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、2.2%(税抜2.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(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3月12日から2021年9月10日まで

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

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。

(1 0) 【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)

(1 1) 【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

(1 2) 【その他】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日には取得またはスイッチングのお申込みの受付は行いません。

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(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付を取り消すことができるものとします。

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

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

知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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。

<スイッチング>

(基本コース)(リスク抑制コース)の2つのファンド間でスイッチングができます。スイッチングとは、すでに保有しているファンドを解約すると同時に他のファンドの取得の申込みを行うことをいい、ファンドの解約代金が買付代金に充当されます。

スイッチングの際には、税金および各販売会社が定めるお申込手数料がかかる場合があります。

販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

1 日本を除く先進国の株式、債券、不動産投資信託証券(リート)および新興国の株式、債券に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

●DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

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

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

2 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替リスクの低減をめざします。

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

3 基本コース、リスク抑制コースの2コースからお選びいただけます。

●各資産への基本投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直します。

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

●基本コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行います。

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

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

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

●各コース間でスイッチングが可能です。

※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。

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

基本投資比率のイメージ

基本コース

リスク抑制コース



※基本投資比率は、原則として年1回見直しします。
 ※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。

基本コース

投資対象資産の合計資産比率の変更は行いません。



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

リスク抑制コース

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



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

リスク抑制コースでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等は機動的に合計資産比率を減少(現金等*比率を増加)させることで基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることをめざします。
 その後、市場環境回復局面では合計資産比率を増加(現金等*比率を減少)させます。
 ※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

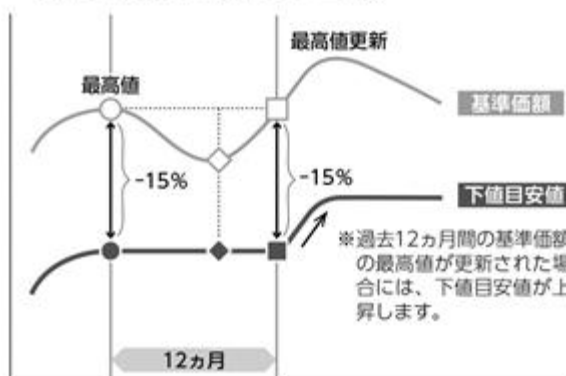
※現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、[DIAMマネーマザーファンド]を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(リスク抑制コース)の下値目安値について

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

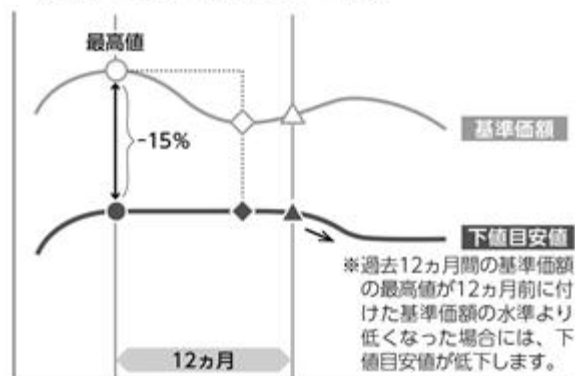
※(基本コース)は、下値目安値を定めておりません。
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

下値目安値が上昇するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が更新された場合には、下値目安値が上昇します。

下値目安値が低下するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が12ヵ月前に付けた基準価額の水準より低くなった場合には、下値目安値が低下します。

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

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

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

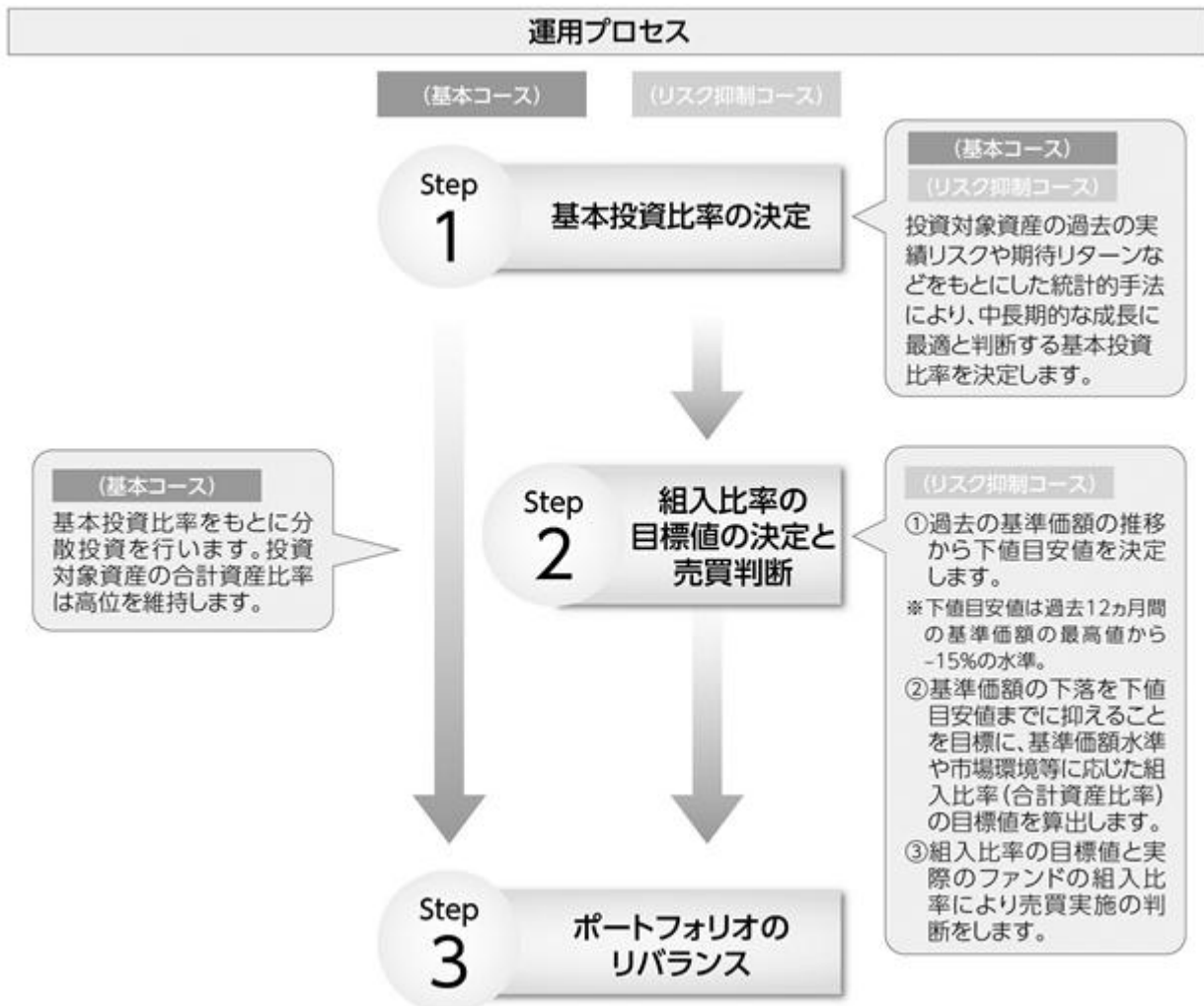
4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

5 年2回決算を行います。

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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



商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

各ファンド

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

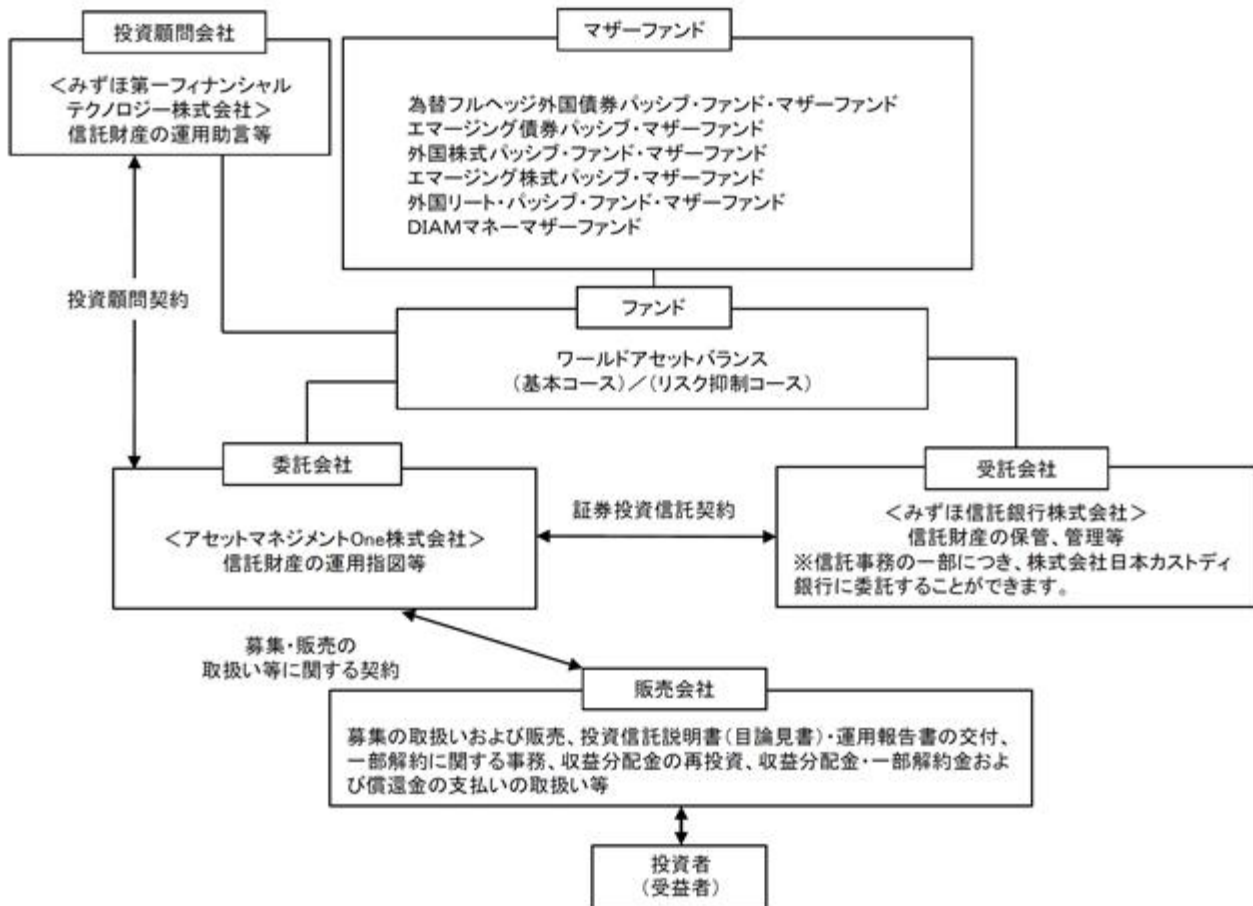
資産複合（投資信託証券（債券、株式、不動産投信）、先物、ETF、短期金融資産） 資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本除く）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、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

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。
 上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2017年1月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・「投資顧問契約」の概要

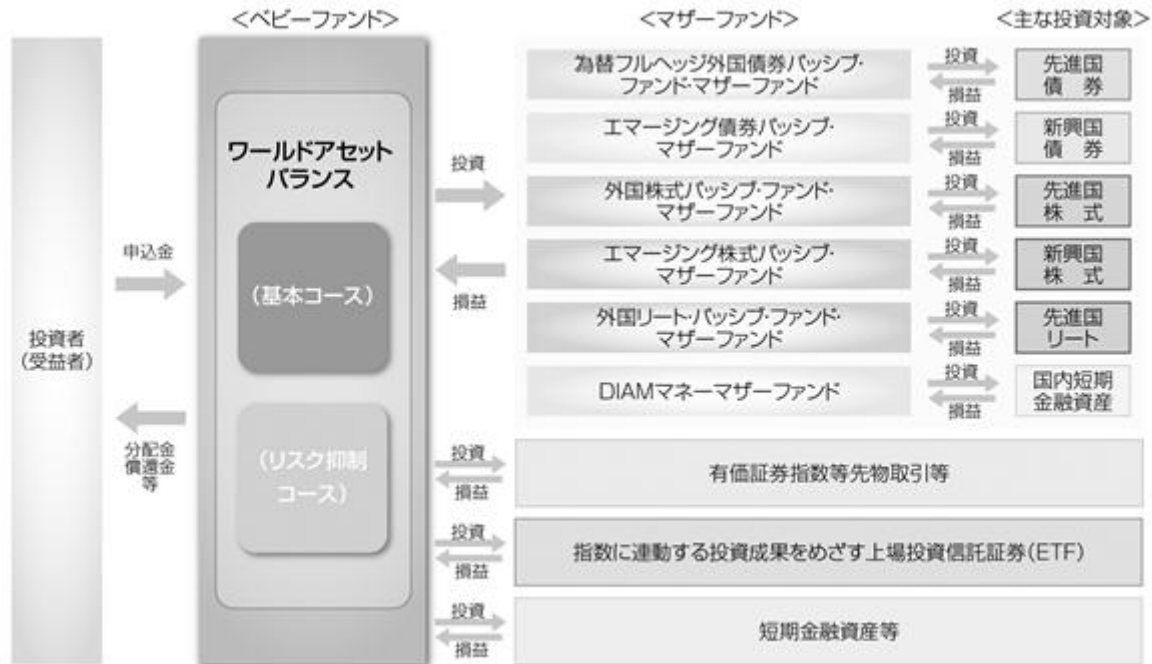
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

「ファミリーファンド方式」とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2020年12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

(2020年12月30日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

ワールドアセットバランス（基本コース）

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）を主要投資対象とします。なお、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

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

- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
 - ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 - ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。
- 一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)を主要投資対象とします。なお、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

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

- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
 - ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 - ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。
- 一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

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

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

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

基準価額の下落を一定水準(下値目安値^(*))までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去12ヵ月間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

(**) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)

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

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

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p>
	<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>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> C subgraph H_Box [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1.年限・通貨構成変化要因] H2[2.インデックス構成銘柄変更] H3[3.リスク量の変更] H4[4.クーポン・償還再投資] end </pre>

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

<p>ファンド名</p>	<p>エマージング債券パッシブ・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>新興国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、当初組入時において、S&PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

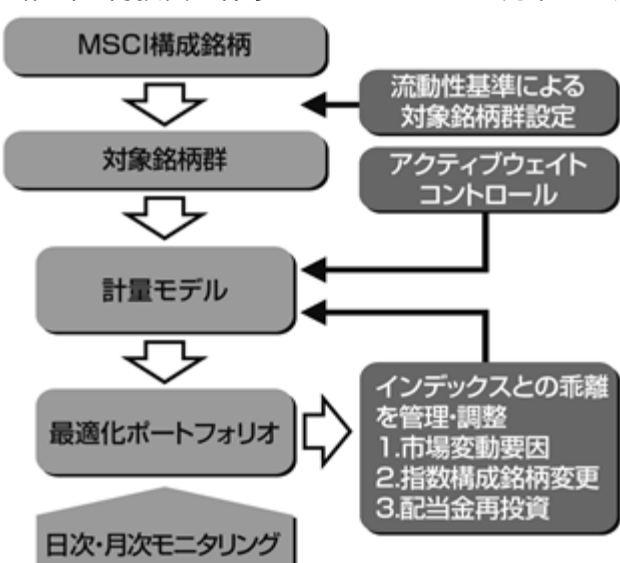
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

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

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

	<p>認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C D --> H["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"] </pre>

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

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

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

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

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

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

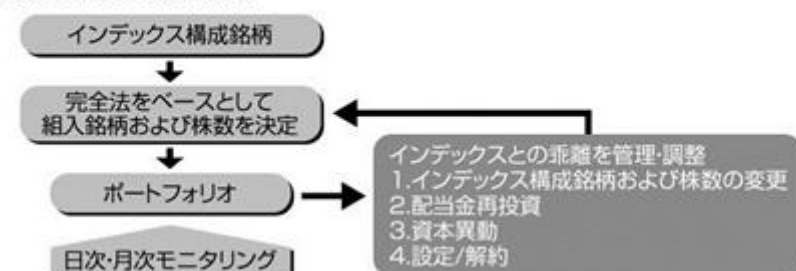
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

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

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

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

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

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

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

ファンド名	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。 (*) 主要格付機関とは、R & I、JCR、Moody's、S & Pとします。 2. 国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。 3. ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡張等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none">1. 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。2. 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。3. 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。4. 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。5. 投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。6. 外貨建て資産への投資は行いません。7. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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2020年12月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

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

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

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

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第29条)

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

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

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

資金の借入れ(約款第35条)

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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

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

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

・金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

・リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

・為替リスク

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

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

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

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

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

・信用リスク

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

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

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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と、受益者毎に異なります。

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

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

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

リスク抑制コースでは、過去12ヵ月間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に15%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

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

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

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

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

注意事項

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

ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

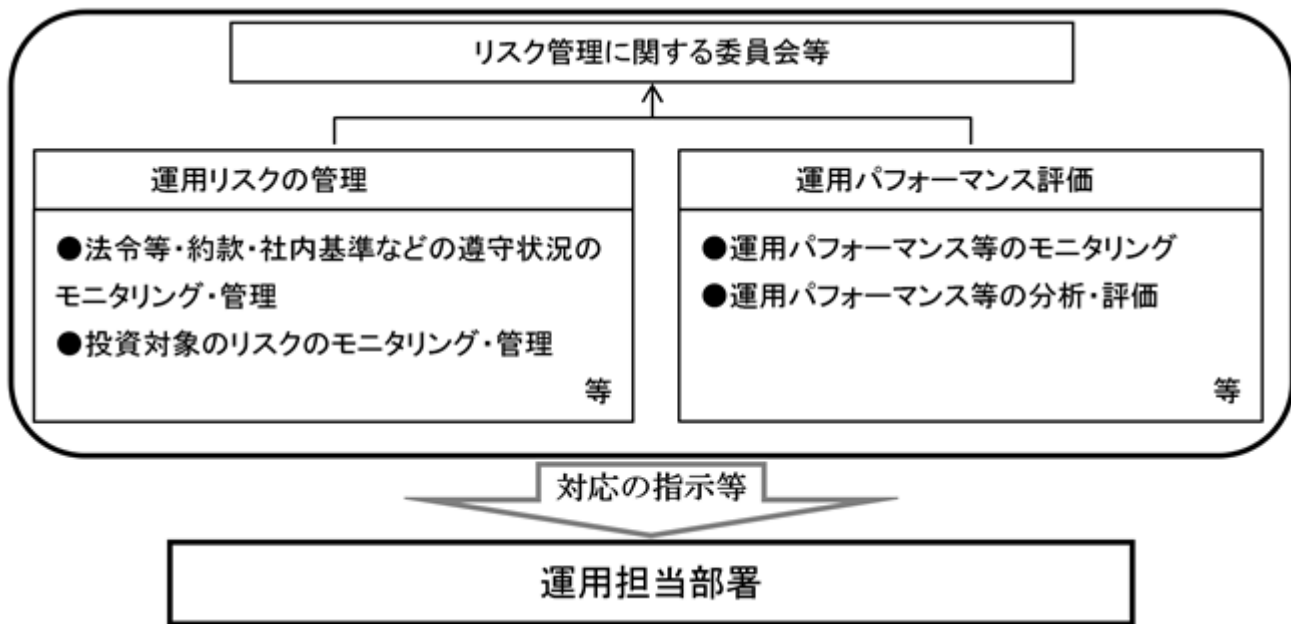
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< リスク管理体制 >

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・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2020年12月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

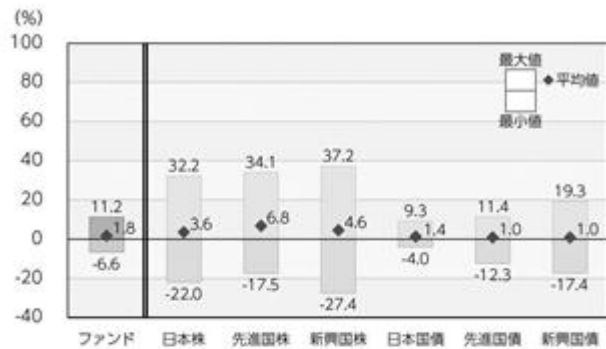
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(基本コース)

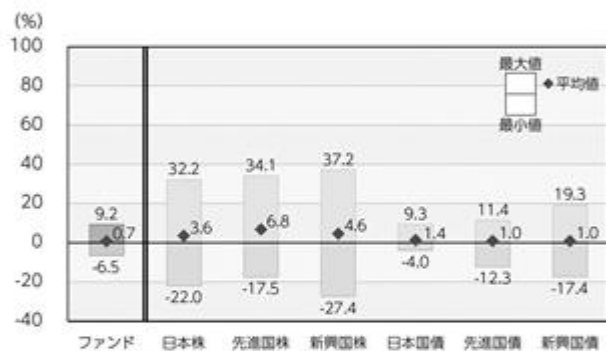


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年1月~2020年12月
代表的な資産クラス:2016年1月~2020年12月

(リスク抑制コース)



ファンド:2018年1月~2020年12月
代表的な資産クラス:2016年1月~2020年12月

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

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(旧東京証券取引所)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、旧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	JPMorgan GBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	[JPMorgan GBI-EMグローバル・ディバーシファイド]は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.243%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.55%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2020年12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ワールドアセットバランス(基本コース)

2020年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	37,524,753	0.36
内 アメリカ	37,524,753	0.36
親投資信託受益証券	10,048,029,081	97.08
内 日本	10,048,029,081	97.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	264,704,063	2.56
純資産総額	10,350,257,897	100.00

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

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

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2020年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	57,838,905	0.16
内 アメリカ	57,838,905	0.16
親投資信託受益証券	24,633,018,759	69.77
内 日本	24,633,018,759	69.77
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,616,621,466	30.07
純資産総額	35,307,479,130	100.00

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

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

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	403,154,416,716	95.96
内 アメリカ	276,197,116,901	65.74
内 イギリス	18,535,951,023	4.41
内 スイス	14,465,237,664	3.44
内 フランス	14,200,662,371	3.38
内 カナダ	14,169,812,792	3.37
内 ドイツ	12,881,053,165	3.07
内 オーストラリア	8,903,024,970	2.12
内 オランダ	7,554,524,465	1.80
内 アイルランド	7,486,733,615	1.78
内 スウェーデン	4,469,090,059	1.06
内 デンマーク	3,504,429,775	0.83
内 スペイン	3,430,923,376	0.82
内 香港	3,294,027,220	0.78
内 イタリア	2,596,725,131	0.62
内 フィンランド	1,708,950,768	0.41
内 ジョージア	1,531,668,258	0.36
内 バミューダ	1,309,435,064	0.31
内 ベルギー	1,263,738,792	0.30
内 シンガポール	1,231,442,380	0.29

内	イスラエル	842,753,988	0.20
内	ノルウェー	815,808,848	0.19
内	ケイマン諸島	762,316,406	0.18
内	ニュージーランド	549,305,092	0.13
内	ルクセンブルグ	374,106,286	0.09
内	オランダ領キュラソー	261,598,549	0.06
内	ポルトガル	238,354,685	0.06
内	オーストリア	231,352,207	0.06
内	リベリア	117,672,917	0.03
内	パナマ	89,904,614	0.02
内	マン島	80,371,965	0.02
内	パプアニューギニア	56,323,370	0.01
新株予約権証券		2,469,821	0.00
内	スイス	2,469,821	0.00
投資信託受益証券		819,088,010	0.19
内	オーストラリア	596,600,722	0.14
内	シンガポール	222,487,288	0.05
投資証券		8,070,772,099	1.92
内	アメリカ	7,360,016,322	1.75
内	イギリス	239,318,245	0.06
内	香港	167,249,200	0.04
内	フランス	145,801,565	0.03
内	オランダ	107,465,510	0.03
内	カナダ	50,921,257	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		8,084,671,089	1.92
純資産総額		420,131,417,735	100.00

その他資産の投資状況

2020年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	9,726,662,282	2.32
内 アメリカ	7,142,121,000	1.70
内 ドイツ	1,598,492,194	0.38
内 イギリス	467,781,792	0.11
内 カナダ	335,153,512	0.08
内 オーストラリア	183,113,784	0.04

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	534,027,209,584	98.73
内 アメリカ	228,744,342,978	42.29
内 フランス	57,425,729,572	10.62
内 イタリア	51,581,442,840	9.54
内 ドイツ	41,956,423,847	7.76
内 イギリス	36,122,783,146	6.68

内 スペイン	32,744,044,944	6.05
内 オーストラリア	14,655,889,206	2.71
内 ベルギー	13,588,478,027	2.51
内 カナダ	10,619,645,050	1.96
内 オランダ	10,542,154,603	1.95
内 オーストリア	8,153,266,152	1.51
内 アイルランド	4,552,414,396	0.84
内 メキシコ	4,418,258,216	0.82
内 フィンランド	3,430,304,412	0.63
内 ポーランド	3,189,699,453	0.59
内 デンマーク	2,673,854,909	0.49
内 マレーシア	2,472,286,898	0.46
内 シンガポール	2,228,985,763	0.41
内 イスラエル	2,190,088,028	0.40
内 スウェーデン	1,625,275,671	0.30
内 ノルウェー	1,111,841,473	0.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,890,362,822	1.27
純資産総額	540,917,572,406	100.00

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	6,430,459,313	12.21
内 オーストラリア	4,186,656,094	7.95
内 シンガポール	2,243,803,219	4.26
投資証券	46,003,001,219	87.38
内 アメリカ	37,797,907,229	71.80
内 イギリス	3,025,573,251	5.75
内 カナダ	991,977,594	1.88
内 フランス	921,411,382	1.75
内 香港	903,389,599	1.72
内 ベルギー	762,437,378	1.45
内 オランダ	571,814,994	1.09
内 ニュージーランド	269,560,034	0.51
内 スペイン	256,499,165	0.49
内 ドイツ	167,006,606	0.32
内 ガーンジィ	134,579,715	0.26
内 アイルランド	71,721,874	0.14
内 韓国	66,436,677	0.13
内 イスラエル	37,963,454	0.07
内 マン島	14,297,013	0.03
内 イタリア	10,425,254	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	211,656,797	0.40
純資産総額	52,645,117,329	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

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	64,876,646,427	88.79
内 ケイマン諸島	16,156,000,004	22.11
内 韓国	8,785,671,523	12.02
内 台湾	8,154,353,030	11.16
内 中国	7,289,742,510	9.98
内 インド	6,140,695,552	8.40
内 ブラジル	3,250,957,191	4.45
内 南アフリカ	2,201,797,553	3.01
内 ロシア	1,663,331,370	2.28
内 サウジアラビア	1,640,644,823	2.25
内 タイ	1,226,257,467	1.68
内 香港	1,224,461,202	1.68
内 マレーシア	1,011,595,088	1.38
内 インドネシア	899,931,712	1.23
内 メキシコ	888,418,295	1.22
内 バミューダ	494,288,494	0.68
内 フィリピン	492,787,247	0.67
内 カタール	470,104,964	0.64
内 ポーランド	413,293,648	0.57
内 アラブ首長国連邦	358,562,289	0.49
内 チリ	339,143,747	0.46
内 クエート	317,809,445	0.43
内 トルコ	248,499,838	0.34
内 アメリカ	236,044,497	0.32
内 オランダ	217,692,637	0.30
内 ルクセンブルグ	153,099,205	0.21
内 ハンガリー	136,916,552	0.19
内 コロンビア	130,678,860	0.18
内 ギリシャ	73,766,561	0.10
内 チェコ	68,140,236	0.09
内 ジャージー	52,752,873	0.07
内 エジプト	50,999,349	0.07
内 マン島	26,210,793	0.04
内 イギリス領バージン諸島	22,236,209	0.03
内 ペルー	20,323,565	0.03
内 シンガポール	10,034,928	0.01
内 アルゼンチン	4,802,888	0.01
内 パキスタン	4,600,282	0.01
新株予約権証券	13,061	0.00
内 タイ	13,061	0.00
投資信託受益証券	402,777,936	0.55
内 メキシコ	257,779,744	0.35
内 ブラジル	144,998,192	0.20
投資証券	57,487,336	0.08
内 メキシコ	29,188,938	0.04
内 南アフリカ	28,298,398	0.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,732,654,129	10.58
純資産総額	73,069,578,889	100.00

その他資産の投資状況

2020年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	8,145,236,790	11.15
内 アメリカ	8,145,236,790	11.15

(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

2020年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	141,703,964,136	97.35
内 メキシコ	22,779,186,657	15.65
内 インドネシア	19,553,399,477	13.43
内 ロシア	18,788,439,028	12.91
内 ブラジル	15,536,562,085	10.67
内 コロンビア	13,555,720,351	9.31
内 フィリピン	12,594,604,882	8.65
内 南アフリカ	8,667,583,632	5.95
内 パナマ	8,607,264,463	5.91
内 ペルー	7,212,994,798	4.96
内 ハンガリー	5,948,343,515	4.09
内 ルーマニア	5,207,865,875	3.58
内 クロアチア	3,251,999,373	2.23
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,851,552,342	2.65
純資産総額	145,555,516,478	100.00

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ワールドアセットバランス(基本コース)

2020年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,050,723,552	1.4827 4,523,612,882	1.4817 4,520,257,086	- -	43.67
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	350,685,901	4.3411 1,522,397,633	4.4055 1,544,946,736	- -	14.93
3	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	726,772,523	2.0933 1,521,352,923	2.1026 1,528,111,906	- -	14.76

4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,118,167,621	1.3209 1,477,099,427	1.3281 1,485,038,417	- -	14.35
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	812,123,062	1.1836 961,310,068	1.1940 969,674,936	- -	9.37
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	13,300	2,822.44 37,538,518	2,821.41 37,524,753	- -	0.36

(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

2020年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.36
親投資信託受益証券	97.08
合計	97.44

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2020年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,471,809,927	1.4830 11,080,836,562	1.4817 11,070,980,768	- -	31.36
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	848,792,956	4.3411 3,684,719,442	4.4055 3,739,357,367	- -	10.59
3	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	1,755,731,656	2.0940 3,676,558,897	2.1026 3,691,601,379	- -	10.46
4	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,752,165,559	1.3208 3,635,288,441	1.3281 3,655,151,078	- -	10.35
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,073,641,681	1.1836 2,454,532,416	1.1940 2,475,928,167	- -	7.01
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	20,500	2,822.44 57,860,122	2,821.41 57,838,905	- -	0.16

(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

2020年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.16

親投資信託受益証券	69.77
合計	69.93

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,442,893	8,620.95 12,439,121,925	13,959.04 20,141,408,317	- -	4.79
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	606,756	19,281.17 11,698,970,601	23,199.52 14,076,450,990	- -	3.35
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	35,926	233,539.49 8,390,140,066	343,827.00 12,352,328,802	- -	2.94
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	203,005	22,437.25 4,554,874,254	28,646.72 5,815,429,423	- -	1.38
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	25,271	154,556.73 3,905,803,321	182,027.51 4,600,017,457	- -	1.09
6	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	25,277	154,493.27 3,905,126,539	181,928.15 4,598,598,100	- -	1.09
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	62,949	19,763.64 1,244,101,469	68,929.96 4,339,072,366	- -	1.03
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	222,470	15,399.39 3,425,902,875	15,953.48 3,549,172,920	- -	0.84

9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	257,801	13,419.98 3,459,686,485	12,938.53 3,335,567,261	- -	0.79
10	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	142,567	21,291.35 3,035,443,985	22,187.29 3,163,176,086	- -	0.75
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	210,355	13,075.12 2,750,417,859	14,326.46 3,013,644,596	- -	0.72
12	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	243,473	12,531.85 3,051,167,633	12,253.88 2,983,491,359	- -	0.71
13	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	80,435	30,614.51 2,462,478,514	35,950.72 2,891,696,565	-	0.69
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	118,499	22,758.04 2,696,805,820	23,760.49 2,815,594,897	- -	0.67
15	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	152,680	13,949.56 2,129,820,336	18,350.55 2,801,761,974	- -	0.67
16	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	52,112	32,870.93 1,712,969,938	53,585.05 2,792,424,386	- -	0.66
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	75,542	34,510.80 2,607,015,198	35,879.30 2,710,394,836	- -	0.65
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	91,018	25,222.11 2,295,666,796	27,550.66 2,507,606,426	- -	0.60
19	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	94,303	13,397.73 1,263,446,300	23,911.60 2,254,936,086	- -	0.54
20	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	59,521	39,254.77 2,336,483,266	35,959.19 2,140,327,096	- -	0.51
21	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	349,755	6,031.82 2,109,661,715	6,086.83 2,128,900,975	- -	0.51
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	40,386	39,954.72 1,613,611,508	51,968.38 2,098,795,196	- -	0.50
23	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	385,078	4,656.79 1,793,230,411	5,335.42 2,054,554,788	- -	0.49
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	660,162	3,386.89 2,235,902,365	3,106.03 2,050,486,277	- -	0.49

25	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	37,238	41,018.90 1,527,462,026	54,945.04 2,046,043,585	- -	0.49
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	345,110	5,933.77 2,047,804,270	5,602.45 1,933,463,245	- -	0.46
27	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	359,405	6,695.21 2,406,292,086	5,111.86 1,837,229,840	- -	0.44
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	35,905	37,010.75 1,328,871,239	50,310.28 1,806,390,782	- -	0.43
29	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	214,091	8,517.40 1,823,499,592	8,426.96 1,804,138,434	- -	0.43
30	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	186,615	10,763.95 2,008,715,934	9,662.53 1,803,173,409	- -	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年12月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.96
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.19
投資証券	1.92
合計	98.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2020年12月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.19
銀行		5.48
コンピュータ・周辺機器		5.05
医薬品		4.82
情報技術サービス		4.76
半導体・半導体製造装置		4.20
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.05
インターネット販売・通信販売		3.75
保険		3.08
ヘルスケア機器・用品		3.07
資本市場		2.94
石油・ガス・消耗燃料		2.72
化学		2.16
電力		1.97
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.90
バイオテクノロジー		1.82
飲料		1.75
食品		1.71
機械		1.67
自動車		1.67

専門小売り	1.64
娯楽	1.63
ホテル・レストラン・レジャー	1.57
各種電気通信サービス	1.56
金属・鉱業	1.54
繊維・アパレル・贅沢品	1.52
航空宇宙・防衛	1.49
食品・生活必需品小売り	1.41
家庭用品	1.29
コングロマリット	1.15
メディア	1.15
陸運・鉄道	1.07
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.01
各種金融サービス	0.93
電気設備	0.89
総合公益事業	0.88
専門サービス	0.73
パーソナル用品	0.67
タバコ	0.67
航空貨物・物流サービス	0.64
通信機器	0.64
建設関連製品	0.55
電子装置・機器・部品	0.53
複合小売り	0.51
不動産管理・開発	0.44
商業サービス・用品	0.43
消費者金融	0.38
家庭用耐久財	0.36
容器・包装	0.30
無線通信サービス	0.30
商社・流通業	0.29
自動車部品	0.28
建設・土木	0.27
建設資材	0.25
ヘルスケア・テクノロジー	0.17
運送インフラ	0.15
ガス	0.15
エネルギー設備・サービス	0.13
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11
水道	0.11
紙製品・林産品	0.11
レジャー用品	0.09
販売	0.08
海運業	0.07
旅客航空輸送業	0.06
合計	95.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	2,687,895,000	98.23 2,640,333,720	97.28 2,614,817,854	0.625 2030/8/15	0.48
2	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	2,310,120,000	105.77 2,443,484,210	105.76 2,443,312,855	1.5 2026/8/15	0.45
3	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	2,469,510,000	98.72 2,438,026,782	97.57 2,409,701,554	0.625 2030/5/15	0.45
4	FRANCE OAT 0.5 05/25/25 フランス	国債証券	2,081,980,000	105.40 2,194,538,950	105.24 2,191,263,130	0.5 2025/5/25	0.41
5	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	1,830,619,000	114.65 2,098,940,173	114.26 2,091,798,904	4.25 2023/10/25	0.39
6	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,820,565,000	116.17 2,115,129,676	114.59 2,086,253,704	2.75 2028/2/15	0.39
7	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,795,725,000	116.66 2,095,020,211	115.74 2,078,551,687	2.875 2028/5/15	0.38
8	DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 ドイツ	国債証券	1,194,599,500	170.51 2,036,958,396	172.86 2,065,038,928	2.5 2046/8/15	0.38
9	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	1,663,045,000	123.33 2,051,065,059	123.14 2,047,877,603	2.75 2027/10/25	0.38
10	US T N/B 0.125 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,927,170,000	99.97 1,926,736,834	99.98 1,926,944,154	0.125 2022/9/30	0.36
11	ITALY BTPS 5.25 11/01/29 イタリア	国債証券	1,340,592,000	139.92 1,875,789,112	142.13 1,905,517,468	5.25 2029/11/1	0.35
12	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	1,473,889,500	127.51 1,879,474,768	127.83 1,884,212,967	2.5 2030/5/25	0.35
13	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	1,561,485,000	117.96 1,842,055,373	119.44 1,865,177,123	1.5 2031/5/25	0.34
14	US T N/B 1.375 06/30/23 アメリカ	国債証券	1,799,865,000	103.24 1,858,264,062	103.07 1,855,267,093	1.375 2023/6/30	0.34
15	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,780,200,000	102.84 1,830,849,609	102.80 1,830,198,571	1.625 2022/11/15	0.34
16	US T N/B 0.125 08/31/22 アメリカ	国債証券	1,822,635,000	99.97 1,822,103,474	99.99 1,822,563,788	0.125 2022/8/31	0.34
17	US T N/B 1.125 08/15/40 アメリカ	国債証券	1,932,345,000	95.62 1,847,857,168	94.22 1,820,782,258	1.125 2040/8/15	0.34
18	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	1,640,475,000	111.83 1,834,622,372	110.82 1,817,979,512	2.25 2027/8/15	0.34
19	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	950,855,500	187.94 1,787,072,418	189.59 1,802,787,797	4.5 2041/4/25	0.33
20	US T N/B 0.125 11/30/22 アメリカ	国債証券	1,795,725,000	99.94 1,794,697,557	100.01 1,796,075,722	0.125 2022/11/30	0.33
21	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,639,440,000	107.68 1,765,443,396	107.73 1,766,240,437	2.25 2024/11/15	0.33
22	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,527,660,000	117.40 1,793,487,940	114.62 1,751,080,275	2.625 2029/2/15	0.32
23	FRANCE OAT 3.0 04/25/22 フランス	国債証券	1,666,853,500	106.65 1,777,859,275	104.93 1,749,086,050	3 2022/4/25	0.32

24	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,621,845,000	107.80 1,748,357,836	107.80 1,748,424,925	2.5 2024/5/15	0.32
25	US T N/B 3.0 02/15/49 アメリカ	国債証券	1,331,010,000	135.41 1,802,365,572	131.16 1,745,806,779	3 2049/2/15	0.32
26	US T N/B 0.25 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,731,555,000	100.12 1,733,778,074	100.26 1,736,222,076	0.25 2023/11/15	0.32
27	US T N/B 0.125 10/31/22 アメリカ	国債証券	1,731,555,000	99.94 1,730,572,394	100.01 1,731,757,903	0.125 2022/10/31	0.32
28	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	1,476,945,000	118.08 1,744,032,452	115.99 1,713,140,805	2.875 2028/8/15	0.32
29	US T N/B 2.875 05/15/49 アメリカ	国債証券	1,331,010,000	132.02 1,757,205,623	128.37 1,708,684,087	2.875 2049/5/15	0.32
30	FRANCE OAT 3.25 05/25/45 フランス	国債証券	985,132,000	171.99 1,694,334,747	172.93 1,703,620,291	3.25 2045/5/25	0.31

(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

2020年12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.73
合計	98.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	300,272	10,013.16 3,006,673,354	10,114.01 3,036,957,013	- -	5.77
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	36,195	75,620.67 2,737,090,193	73,358.72 2,655,219,232	- -	5.04
3	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	113,846	14,668.34 1,669,932,001	14,283.00 1,626,062,418	- -	3.09
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	61,810	21,602.25 1,335,235,499	23,577.30 1,457,312,913	- -	2.77
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	133,280	7,389.14 984,824,683	8,620.51 1,148,942,239	- -	2.18
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	169,638	5,826.33 988,367,666	6,539.12 1,109,284,934	- -	2.11
7	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	679,512	1,347.85 915,886,538	1,521.61 1,033,953,613	- -	1.96
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	56,764	16,362.42 928,796,614	16,271.23 923,620,383	- -	1.75
9	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	50,348	17,143.29 863,130,758	18,129.05 912,761,912	- -	1.73

10	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	142,716	6,372.86 909,510,284	6,310.39 900,594,332	- -	1.71
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	139,266	6,039.48 841,095,375	6,040.25 841,202,849	- -	1.60
12	LINK REIT 香港	投資証券	833,920	878.91 732,942,673	946.51 789,317,788	- -	1.50
13	VENTAS INC アメリカ	投資証券	152,343	4,205.58 640,691,025	5,074.60 773,080,549	- -	1.47
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	226,701	2,928.58 663,913,076	3,012.88 683,024,042	- -	1.30
15	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	43,506	14,868.99 646,890,661	15,435.98 671,558,180	- -	1.28
16	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	217,740	2,855.87 621,838,452	3,080.15 670,674,038	- -	1.27
17	SEGRO PLC イギリス	投資証券	484,805	1,267.96 614,716,802	1,339.19 649,248,897	- -	1.23
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	26,374	24,189.38 637,970,900	24,305.93 641,044,861	- -	1.22
19	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	52,276	10,672.47 557,914,556	11,779.33 615,776,516	- -	1.17
20	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	150,462	3,873.27 582,780,416	4,082.03 614,191,902	- -	1.17
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	46,267	12,289.03 568,576,829	12,859.87 594,987,836	- -	1.13
22	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	217,118	2,441.48 530,090,907	2,614.40 567,635,470	- -	1.08
23	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	57,311	9,307.84 533,441,807	9,655.51 553,367,220	- -	1.05
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	70,981	7,105.89 504,383,362	7,261.55 515,432,790	- -	0.98
25	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	216,956	1,989.35 431,603,299	2,245.94 487,272,328	- -	0.93
26	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,101,350	187.14 393,258,841	224.69 472,160,736	- -	0.90
27	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	56,066	6,453.37 361,815,134	8,317.76 466,343,756	- -	0.89
28	UDR INC アメリカ	投資証券	119,208	3,860.09 460,154,666	3,878.14 462,305,909	- -	0.88
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	68,613	6,565.74 450,495,295	6,417.00 440,289,621	- -	0.84
30	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	285,619	1,248.54 356,609,594	1,485.22 424,208,479	- -	0.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	12.21
投資証券	87.38

合計	99.60
----	-------

(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

2020年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,011,083	1,371.75 2,758,711,803	1,895.19 3,811,404,501	- -	5.22
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	155,098	24,807.87 3,847,651,453	24,452.90 3,792,597,435	- -	5.19
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	470,300	6,666.04 3,135,040,234	7,082.17 3,330,746,902	- -	4.56
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	389,617	5,291.18 2,061,536,131	7,454.15 2,904,267,456	- -	3.97
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	294,200	2,823.24 830,599,448	3,649.89 1,073,797,638	- -	1.47
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	35,528	21,270.98 755,715,533	20,627.19 732,843,161	- -	1.00
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	233,224	2,251.15 525,022,498	2,825.87 659,060,938	- -	0.90

8	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	70,449	7,065.62 497,766,365	8,915.48 628,087,355	- -	0.86
9	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,819,530	80.26 627,643,691	78.63 614,861,373	- -	0.84
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	484,000	1,085.28 525,277,795	1,246.89 603,494,760	- -	0.83
11	PINDUODUO INC ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	30,994	10,553.12 327,083,616	17,200.66 533,117,411	- -	0.73
12	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉄 業	300,121	1,083.19 325,089,541	1,732.69 520,017,555	- -	0.71
13	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,167,000	265.03 309,298,530	437.88 511,005,960	- -	0.70
14	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	104,316	2,639.74 275,367,153	4,775.48 498,160,014	- -	0.68
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	138,563	2,689.81 372,709,411	3,576.90 495,627,241	- -	0.68
16	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	278,818	1,199.20 334,359,453	1,775.42 495,020,726	- -	0.68
17	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	44,054	8,056.40 354,916,860	11,043.19 486,497,132	- -	0.67
18	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	66,419	4,639.79 308,170,406	6,873.43 456,527,011	- -	0.62
19	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	22,075	12,674.30 279,785,322	20,189.74 445,688,620	- -	0.61
20	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	222,728	1,185.54 264,055,166	1,532.31 341,290,012	- -	0.47

21	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	123,507	1,941.12 239,743,009	2,701.11 333,607,227	- -	0.46
22	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,002,225	288.32 288,968,750	332.67 333,412,195	- -	0.46
23	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	33,756	8,525.95 287,802,221	9,671.03 326,455,626	- -	0.45
24	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	4,936,235	65.01 320,946,729	65.41 322,903,812	- -	0.44
25	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	429,749	569.25 244,638,178	750.89 322,696,805	- -	0.44
26	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	251,000	783.49 196,656,261	1,259.57 316,152,697	- -	0.43
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	75,288	3,108.58 234,038,965	4,161.30 313,296,707	- -	0.43
28	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信 サービス	496,500	733.68 364,276,929	596.07 295,952,478	- -	0.41
29	LG CHEM LTD 韓国	株式 化学	3,790	51,238.57 194,194,200	77,397.60 293,336,904	- -	0.40
30	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	485,101	505.45 245,198,915	579.39 281,064,122	- -	0.38

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年12月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	88.79
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.55
投資証券	0.08
合計	89.42

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2020年12月30日現在

業種	国内/外国	投資比率（％）
銀行	外国	11.00

インターネット販売・通信販売	9.79
半導体・半導体製造装置	7.52
インタラクティブ・メディアおよびサービス	6.30
コンピュータ・周辺機器	6.00
石油・ガス・消耗燃料	4.50
金属・鉱業	3.43
保険	2.61
自動車	2.56
化学	2.29
電子装置・機器・部品	2.23
情報技術サービス	1.80
不動産管理・開発	1.78
食品	1.69
無線通信サービス	1.67
医薬品	1.31
食品・生活必需品小売り	1.14
娯楽	1.04
飲料	1.02
資本市場	1.02
各種電気通信サービス	0.98
コングロマリット	0.90
バイオテクノロジー	0.90
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.82
繊維・アパレル・贅沢品	0.82
建設資材	0.77
各種消費者サービス	0.68
貯蓄・抵当・不動産金融	0.68
ホテル・レストラン・レジャー	0.65
電力	0.65
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.59
パーソナル用品	0.59
ガス	0.52
各種金融サービス	0.52
運送インフラ	0.50
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.49
専門小売り	0.49
自動車部品	0.47
機械	0.46
複合小売り	0.44
電気設備	0.43
建設・土木	0.42
家庭用品	0.40
ヘルスケア機器・用品	0.38
消費者金融	0.38
家庭用耐久財	0.36
ソフトウェア	0.33
タバコ	0.26
陸運・鉄道	0.24
航空貨物・物流サービス	0.23
商業サービス・用品	0.22

紙製品・林産品	0.20
通信機器	0.20
ヘルスケア・テクノロジー	0.20
メディア	0.18
水道	0.13
海運業	0.13
旅客航空輸送業	0.11
航空宇宙・防衛	0.09
レジャー用品	0.08
エネルギー設備・サービス	0.07
総合公益事業	0.03
専門サービス	0.02
商社・流通業	0.02
建設関連製品	0.02
容器・包装	0.01
販売	0.00
合計	88.79

(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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2020年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,691,000,000	132.44 3,564,001,800	138.47 3,726,227,700	5.25 2047/6/23	2.56
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	2,070,000,000	125.81 2,604,343,590	126.62 2,621,220,300	5.1 2035/3/28	1.80
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,863,000,000	116.02 2,161,573,695	122.12 2,275,188,750	5 2045/6/15	1.56
4	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,904,400,000	115.13 2,192,604,030	116.75 2,223,387,000	4.375 2029/3/21	1.53
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,449,000,000	134.31 1,946,245,050	139.03 2,014,573,680	5.625 2042/4/4	1.38
6	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,438,650,000	128.10 1,842,921,000	133.91 1,926,503,408	6.05 2040/1/11	1.32
7	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 メキシコ	国債証券	1,366,200,000	136.12 1,859,791,500	137.71 1,881,394,020	6.75 2034/9/27	1.29
8	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,593,900,000	113.66 1,811,628,913	115.61 1,842,774,733	4.75 2026/5/27	1.27
9	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,593,900,000	114.77 1,829,349,045	115.19 1,836,088,323	6 2024/1/26	1.26
10	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,666,350,000	109.04 1,817,044,965	109.85 1,830,593,787	4.25 2025/1/7	1.26

11	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,552,500,000	112.27 1,743,091,110	117.53 1,824,769,687	4.5 2029/4/22	1.25
12	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,573,200,000	107.66 1,693,840,014	114.41 1,800,042,854	5.875 2025/9/16	1.24
13	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,138,500,000	156.14 1,777,694,782	157.17 1,789,488,607	5.625 2050/11/18	1.23
14	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,593,900,000	110.17 1,756,061,730	110.02 1,753,725,134	4.875 2023/9/16	1.20
15	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,283,400,000	121.87 1,564,193,430	130.87 1,679,649,750	5.55 2045/1/21	1.15
16	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,128,150,000	146.54 1,653,240,172	147.64 1,665,600,660	6.7 2036/1/26	1.14
17	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	931,500,000	176.56 1,644,682,275	177.74 1,655,648,100	7.625 2041/3/29	1.14
18	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,428,300,000	108.47 1,549,372,230	112.01 1,599,974,518	4.625 2028/1/13	1.10
19	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,386,900,000	113.02 1,567,523,025	114.26 1,584,774,570	4.25 2027/6/23	1.09
20	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,428,300,000	101.40 1,448,303,445	110.92 1,584,406,048	5 2045/1/27	1.09
21	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,384,830,000	114.48 1,585,478,205	114.26 1,582,309,527	5.375 2024/3/25	1.09
22	ROMANIA 4.875 01/22/24 ルーマニア	国債証券	1,407,600,000	110.83 1,560,079,305	111.86 1,574,544,175	4.875 2024/1/22	1.08
23	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	983,250,000	157.21 1,545,771,465	157.44 1,548,046,400	7.75 2038/1/17	1.06
24	BRAZIL 8.25 01/20/34 ブラジル	国債証券	1,055,700,000	140.59 1,484,237,610	145.40 1,534,987,800	8.25 2034/1/20	1.05
25	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	910,800,000	162.83 1,483,120,017	165.06 1,503,402,866	9.5 2030/2/2	1.03
26	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	1,138,500,000	121.03 1,377,984,510	129.60 1,475,496,000	5.625 2044/2/26	1.01
27	ROMANIA 4.375 08/22/23 ルーマニア	国債証券	1,345,500,000	107.25 1,443,127,410	109.20 1,469,369,421	4.375 2023/8/22	1.01
28	PANAMA 4.5 04/01/56 パナマ	国債証券	1,138,500,000	126.08 1,435,513,950	128.90 1,467,526,500	4.5 2056/4/1	1.01
29	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,200,600,000	111.41 1,337,679,540	119.17 1,430,869,077	5.625 2047/2/21	0.98
30	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,242,000,000	113.93 1,415,086,155	114.17 1,418,074,614	5.75 2023/11/22	0.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年12月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.35

合計	97.35
----	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

ワールドアセットバランス(基本コース)

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ワールドアセットバランス(基本コース)

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Mar21	買建	371	7,059,500,055	7,142,121,000	1.70
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar21	買建	353	1,567,054,296	1,598,492,194	0.38
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar21	買建	51	464,482,739	467,781,792	0.11
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar21	買建	20	336,129,291	335,153,512	0.08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Mar21	買建	14	180,979,191	183,113,784	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
 該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2020年12月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	ICE - U S	MINI MSCI EMG MKT Mar21	買建	1,237	8,021,474,595	8,145,236,790	11.15

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

ワールドアセットバランス（基本コース）

直近日（2020年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
第2計算期間末 (2017年12月11日)	13,684	13,684	1.0542	1.0542
第3計算期間末 (2018年6月11日)	16,409	16,409	1.0376	1.0376
第4計算期間末 (2018年12月11日)	14,083	14,083	1.0007	1.0007
第5計算期間末 (2019年6月11日)	12,878	12,878	1.0565	1.0565
第6計算期間末 (2019年12月11日)	12,003	12,003	1.0853	1.0853
第7計算期間末 (2020年6月11日)	11,343	11,343	1.0724	1.0724
第8計算期間末 (2020年12月11日)	10,467	10,467	1.1486	1.1486
2019年12月末日	12,037	-	1.0988	-
2020年1月末日	12,061	-	1.1060	-
2月末日	11,790	-	1.0858	-
3月末日	10,727	-	1.0015	-

4月末日	11,033	-	1.0335	-
5月末日	11,134	-	1.0463	-
6月末日	11,021	-	1.0634	-
7月末日	11,113	-	1.0979	-
8月末日	11,008	-	1.1095	-
9月末日	10,472	-	1.0944	-
10月末日	10,286	-	1.0961	-
11月末日	10,557	-	1.1439	-
12月末日	10,350	-	1.1546	-

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

直近日(2020年12月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	10,386	10,386	1.0337	1.0337
第2計算期間末 (2017年12月11日)	47,243	47,243	1.0544	1.0544
第3計算期間末 (2018年6月11日)	64,853	64,853	1.0356	1.0356
第4計算期間末 (2018年12月11日)	53,883	53,883	0.9975	0.9975
第5計算期間末 (2019年6月11日)	49,438	49,438	1.0392	1.0392
第6計算期間末 (2019年12月11日)	46,310	46,310	1.0681	1.0681
第7計算期間末 (2020年6月11日)	41,188	41,188	1.0437	1.0437
第8計算期間末 (2020年12月11日)	36,032	36,032	1.0685	1.0685
2019年12月末日	46,223	-	1.0812	-
2020年1月末日	45,093	-	1.0890	-
2月末日	43,760	-	1.0689	-
3月末日	41,609	-	1.0336	-
4月末日	41,469	-	1.0384	-
5月末日	41,277	-	1.0395	-
6月末日	40,195	-	1.0412	-
7月末日	39,241	-	1.0489	-
8月末日	38,633	-	1.0524	-
9月末日	37,338	-	1.0424	-
10月末日	36,379	-	1.0408	-
11月末日	36,514	-	1.0660	-
12月末日	35,307	-	1.0722	-

【分配の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

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

【収益率の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4
第2計算期間	1.9
第3計算期間	1.6
第4計算期間	3.6
第5計算期間	5.6
第6計算期間	2.7
第7計算期間	1.2
第8計算期間	7.1

(注) 収益率は期間騰落率です。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

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

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,868,621,462	62,212,876
第2計算期間	7,912,713,431	738,193,959
第3計算期間	4,414,882,467	1,581,611,324

第4計算期間	527,482,147	2,267,181,143
第5計算期間	180,523,898	2,065,395,074
第6計算期間	287,056,004	1,416,879,908
第7計算期間	213,369,846	696,011,702
第8計算期間	122,826,944	1,586,765,325

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569
第3計算期間	23,144,363,900	5,324,740,324
第4計算期間	2,278,919,156	10,886,978,597
第5計算期間	226,859,362	6,670,815,337
第6計算期間	398,143,626	4,613,079,433
第7計算期間	284,570,545	4,182,089,512
第8計算期間	108,436,378	5,849,150,571

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

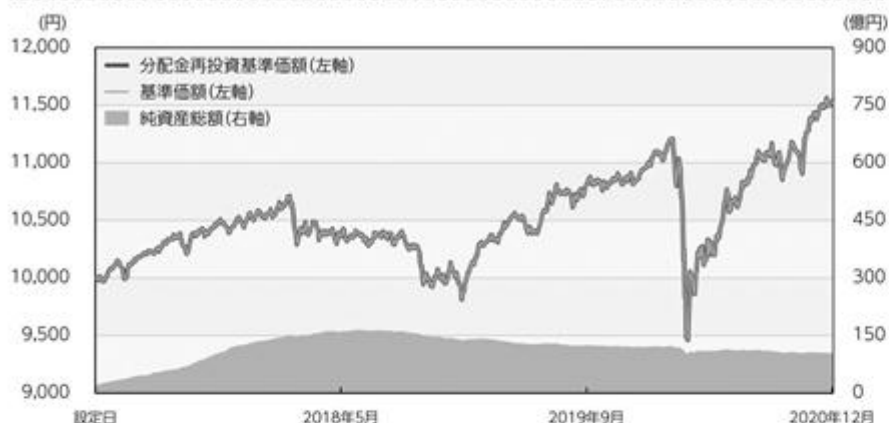
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2020年12月30日

(基本コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2020年12月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

2018年12月	0円
2019年6月	0円
2019年12月	0円
2020年6月	0円
2020年12月	0円
設定来累計	0円

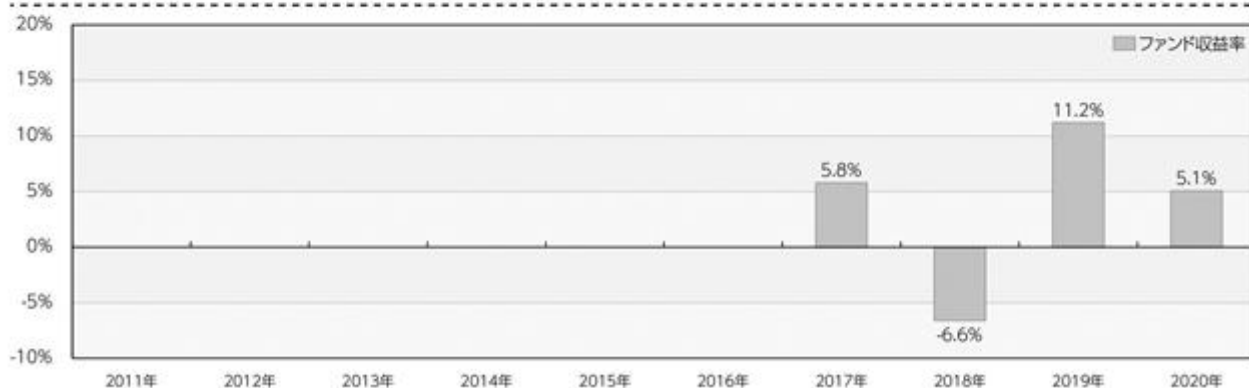
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	43.67
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.93
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.76
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.35
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.37
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.36

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

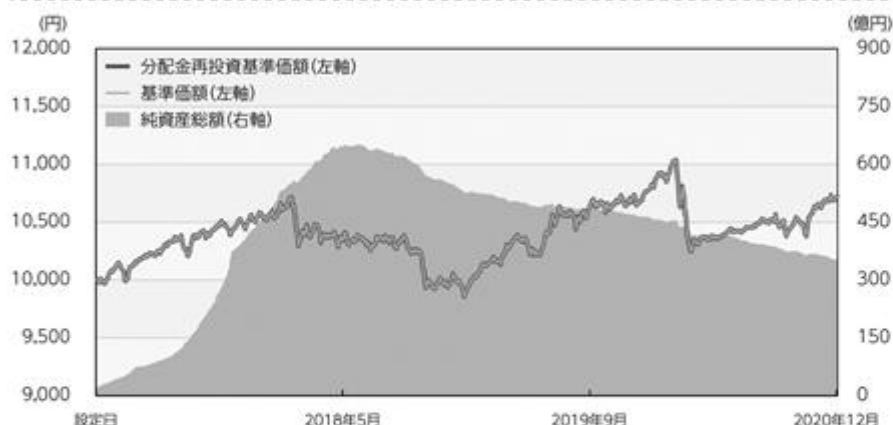
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年12月30日

(リスク抑制コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2020年12月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

2018年12月	0円
2019年6月	0円
2019年12月	0円
2020年6月	0円
2020年12月	0円
設定来累計	0円

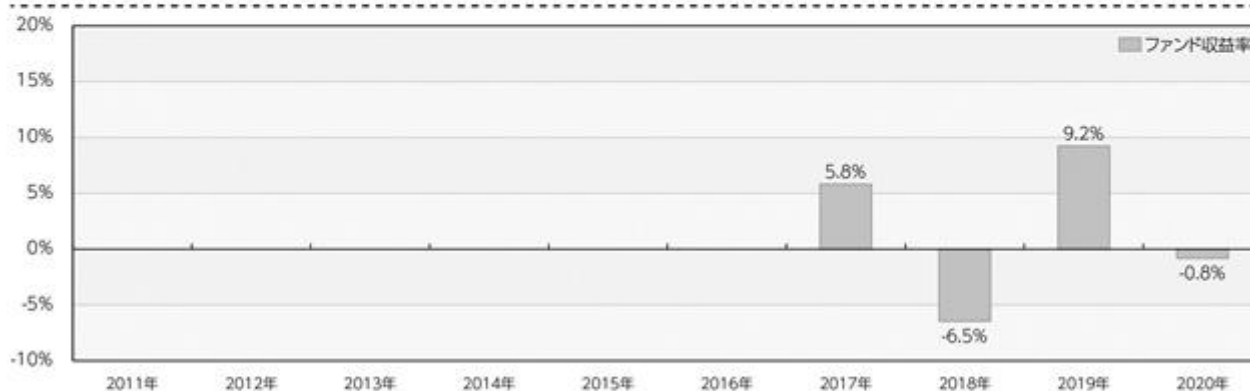
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	31.36
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.59
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.46
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.35
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	7.01
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.16

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年12月30日

主要な資産の状況

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.79
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.35
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.94
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	1.38
5	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.09

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.48
2	US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	アメリカ	1.5	2026/8/15	0.45
3	US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/5/15	0.45
4	FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	フランス	0.5	2025/5/25	0.41
5	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	フランス	4.25	2023/10/25	0.39

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	5.77
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.04
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.09
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.77
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.18

■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	5.22
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	5.19
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	4.56
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.97
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.47

○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:2020年12月30日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.56
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.80
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.56
4	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	国債証券	ロシア	4.375	2029/3/21	1.53
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.38

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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）

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

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

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

（４）【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知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。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にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支

払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

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

り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

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

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年6月11日、12月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

ワールドアセットバランス(基本コース)

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2020年6月12日から2020年12月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ワールドアセットバランス（基本コース）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 2020年6月11日現在	第8期 2020年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,652,517	2,710,662
コール・ローン	234,047,216	365,889,546
投資信託受益証券	32,079,672	37,723,491
親投資信託受益証券	11,147,151,424	10,156,192,544
派生商品評価勘定	32,982,987	10,792,255
未収入金	-	342,118
流動資産合計	11,448,913,816	10,573,650,616
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,598,057	10,122,380
未払金	-	133,452
未払解約金	19,715,780	28,310,671
未払受託者報酬	1,891,833	1,786,932
未払委託者報酬	69,368,971	65,522,337
その他未払費用	229,350	213,803
流動負債合計	105,803,991	106,089,575
負債合計	105,803,991	106,089,575
純資産の部		
元本等		
元本	10,577,163,269	9,113,224,888
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	765,946,556	1,354,336,153
（分配準備積立金）	647,065,158	1,023,620,542
元本等合計	11,343,109,825	10,467,561,041
純資産合計	11,343,109,825	10,467,561,041
負債純資産合計	11,448,913,816	10,573,650,616

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第7期 自 2019年12月12日 至 2020年6月11日	第8期 自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
営業収益		
受取配当金	557,682	132,343
受取利息	7,934	249
有価証券売買等損益	128,021,158	707,584,285
為替差損益	50,930,459	97,076,792
営業収益合計	76,525,083	804,793,669
営業費用		
支払利息	74,315	50,700
受託者報酬	1,891,833	1,786,932
委託者報酬	69,368,971	65,522,337
その他費用	561,430	531,498
営業費用合計	71,896,549	67,891,467
営業利益又は営業損失()	148,421,632	736,902,202
経常利益又は経常損失()	148,421,632	736,902,202
当期純利益又は当期純損失()	148,421,632	736,902,202
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()	11,124,469	46,098,820
期首剰余金又は期首欠損金()	943,838,899	765,946,556
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,905,796	12,631,729
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	18,905,796	12,631,729
剰余金減少額又は欠損金増加額	59,500,976	115,045,514
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	59,500,976	115,045,514
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()	765,946,556	1,354,336,153

(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8期	
	自 2020年6月12日	至 2020年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第7期	第8期
	2020年6月11日現在	2020年12月11日現在
1. 期首元本額	11,059,805,125円	10,577,163,269円
期中追加設定元本額	213,369,846円	122,826,944円
期中一部解約元本額	696,011,702円	1,586,765,325円
2. 受益権の総数	10,577,163,269口	9,113,224,888口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期	第8期
	自 2019年12月12日 至 2020年6月11日	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（72,928,594円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（285,738,990円）及び分配準備積立金（574,136,564円）より分配対象収益は932,804,148円（1万口当たり881.90円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（104,326,838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（368,760,635円）、信託約款に規定される収益調整金（330,715,611円）及び分配準備積立金（550,533,069円）より分配対象収益は1,354,336,153円（1万口当たり1,486.12円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第7期	第8期
	自 2019年12月12日 至 2020年6月11日	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期	第8期
	2020年6月11日現在	2020年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第7期 2020年6月11日現在	第8期 2020年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	811,243	6,543,165
親投資信託受益証券	141,456,525	617,186,405
合計	142,267,768	623,729,570

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第7期 2020年6月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	5,663,934,930	-	5,645,550,000	18,384,930
アメリカ・ドル	4,750,735,712	-	4,719,075,200	31,660,512
イギリス・ポンド	127,964,064	-	130,838,400	2,874,336
イスラエル・シェケル	2,443,720	-	2,492,800	49,080

オーストラリア・ドル	92,974,041	-	96,285,600	3,311,559
カナダ・ドル	70,584,030	-	71,748,000	1,163,970
シンガポール・ドル	40,487,389	-	41,000,800	513,411
スイス・フラン	54,984,125	-	55,585,600	601,475
スウェーデン・クローナ	15,252,706	-	15,481,200	228,494
デンマーク・クローネ	12,061,800	-	12,255,000	193,200
ニュージーランド・ドル	5,362,440	-	5,580,800	218,360
ノルウェー・クローネ	3,106,992	-	3,217,200	110,208
メキシコ・ペソ	16,361,228	-	16,393,000	31,772
ユーロ	215,715,600	-	219,240,000	3,524,400
香港・ドル	222,536,475	-	221,214,000	1,322,475
南アフリカ・ランド	33,364,608	-	35,142,400	1,777,792
合計	5,663,934,930	-	5,645,550,000	18,384,930

種類	第8期 2020年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	5,638,107,875	-	5,637,438,000	669,875
アメリカ・ドル	4,543,284,720	-	4,533,862,800	9,421,920
イギリス・ポンド	126,559,615	-	125,798,400	761,215
イスラエル・シェケル	2,520,800	-	2,555,200	34,400
オーストラリア・ドル	111,922,140	-	114,288,800	2,366,660
カナダ・ドル	74,642,451	-	75,841,500	1,199,049
シンガポール・ドル	43,546,440	-	43,612,800	66,360
スイス・フラン	52,844,800	-	54,022,400	1,177,600
スウェーデン・クローナ	18,372,623	-	18,603,200	230,577
デンマーク・クローネ	13,214,962	-	13,406,300	191,338
ニュージーランド・ドル	6,584,850	-	6,633,000	48,150
ノルウェー・クローネ	3,167,694	-	3,202,200	34,506
メキシコ・ペソ	25,315,860	-	25,485,600	169,740
ユーロ	224,164,800	-	227,340,000	3,175,200
香港・ドル	340,954,920	-	340,345,800	609,120
南アフリカ・ランド	51,011,200	-	52,440,000	1,428,800
合計	5,638,107,875	-	5,637,438,000	669,875

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第7期 2020年6月11日現在	第8期 2020年12月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0724円 (10,724円)	1.1486円 (11,486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

2020年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	13,300.000	362,691.000	
	アメリカ・ドル	小計	13,300.000	362,691.000 (37,723,491)	
投資信託受益証券 合計			13,300	37,723,491 (37,723,491)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	362,207,966	1,572,417,221	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	812,123,062	961,310,068	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,050,723,552	4,523,612,882	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,171,472,526	1,547,515,206	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	741,096,435	1,551,337,167		
	日本円 小計		6,137,623,541	10,156,192,544	
親投資信託受益証券 合計			6,137,623,541	10,156,192,544	
合計				10,193,916,035 (37,723,491)	

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

（注）

1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.36	0.37

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

【ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第7期 2020年6月11日現在	第8期 2020年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,768,571	3,867,101
コール・ローン	15,255,905,827	3,585,845,602
国債証券	19,104,340,000	10,002,100,000
投資信託受益証券	49,446,111	58,145,230
親投資信託受益証券	7,136,638,000	22,691,935,758
派生商品評価勘定	20,987,583	24,712,095
未収利息	38,497,476	57,204,240
前払費用	38,021,905	-
流動資産合計	41,647,605,473	36,423,810,026
資産合計	41,647,605,473	36,423,810,026
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,832,559	23,343,919
未払解約金	179,346,767	129,251,845
未払受託者報酬	7,162,456	6,329,372
未払委託者報酬	262,624,883	232,078,818
その他未払費用	634,862	577,061
流動負債合計	459,601,527	391,581,015
負債合計	459,601,527	391,581,015
純資産の部		
元本等		
元本	39,462,378,684	33,721,664,491
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,725,625,262	2,310,564,520
(分配準備積立金)	1,847,474,550	1,765,776,885
元本等合計	41,188,003,946	36,032,229,011
純資産合計	41,188,003,946	36,032,229,011
負債純資産合計	41,647,605,473	36,423,810,026

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第7期 自 2019年12月12日 至 2020年6月11日	第8期 自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
営業収益		
受取配当金	859,586	203,988
受取利息	38,585,674	66,519,247
有価証券売買等損益	1,112,732,576	877,454,088
為替差損益	392,062,846	168,460,027
営業収益合計	681,224,470	1,112,637,350
営業費用		
支払利息	2,382,253	1,894,421
受託者報酬	7,162,456	6,329,372
委託者報酬	262,624,883	232,078,818
その他費用	966,942	894,756
営業費用合計	273,136,534	241,197,367
営業利益又は営業損失()	954,361,004	871,439,983
経常利益又は経常損失()	954,361,004	871,439,983
当期純利益又は当期純損失()	954,361,004	871,439,983
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()	5,422,801	35,864,299
期首剰余金又は期首欠損金()	2,950,787,535	1,725,625,262
剰余金増加額又は欠損金減少額	19,361,512	5,158,995
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	19,361,512	5,158,995
剰余金減少額又は欠損金増加額	284,739,980	255,795,421
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	284,739,980	255,795,421
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	1,725,625,262	2,310,564,520

(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8期	
	自 2020年6月12日	至 2020年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第7期	第8期
	2020年6月11日現在	2020年12月11日現在
1. 期首元本額	43,359,897,651円	39,462,378,684円
期中追加設定元本額	284,570,545円	108,436,378円
期中一部解約元本額	4,182,089,512円	5,849,150,571円
2. 受益権の総数	39,462,378,684口	33,721,664,491口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期	第8期
	自 2019年12月12日 至 2020年6月11日	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(75,257,004円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,102,722,394円)及び分配準備積立金(1,772,217,546円)より分配対象収益は2,950,196,944円(1万口当たり747.59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(191,725,867円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(947,021,906円)及び分配準備積立金(1,574,051,018円)より分配対象収益は2,712,798,791円(1万口当たり804.46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7期 自 2019年12月12日 至 2020年6月11日	第8期 自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期	第8期
	2020年6月11日現在	2020年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第7期	第8期
	2020年6月11日現在	2020年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	58,980,000	69,900,000
投資信託受益証券	1,250,412	10,085,330
親投資信託受益証券	97,548,949	938,736,695
合計	157,779,361	878,922,025

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第7期			
	2020年6月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	3,631,150,724	-	3,619,995,700	11,155,024
アメリカ・ドル	3,023,587,008	-	3,003,436,800	20,150,208
イギリス・ポンド	86,642,335	-	88,588,500	1,946,165
イスラエル・シェケル	1,527,325	-	1,558,000	30,675
オーストラリア・ドル	63,424,152	-	65,683,200	2,259,048
カナダ・ドル	47,840,287	-	48,629,200	788,913
シンガポール・ドル	28,264,781	-	28,623,200	358,419
スイス・フラン	37,030,125	-	37,435,200	405,075
スウェーデン・クローナ	10,321,380	-	10,476,000	154,620
デンマーク・クローネ	8,202,024	-	8,333,400	131,376
ニュージーランド・ドル	4,021,830	-	4,185,600	163,770
ノルウェー・クローネ	2,108,316	-	2,183,100	74,784
メキシコ・ペソ	10,213,666	-	10,233,500	19,834
ユーロ	146,207,240	-	148,596,000	2,388,760
香港・ドル	140,907,375	-	140,070,000	837,375
南アフリカ・ランド	20,852,880	-	21,964,000	1,111,120
合計	3,631,150,724	-	3,619,995,700	11,155,024

種類	第8期			
	2020年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	12,903,930,576	-	12,902,562,400	1,368,176
アメリカ・ドル	10,354,147,960	-	10,332,675,400	21,472,560
イギリス・ポンド	304,577,535	-	302,745,600	1,831,935
イスラエル・シェケル	5,356,700	-	5,429,800	73,100
オーストラリア・ドル	271,372,860	-	277,111,200	5,738,340
カナダ・ドル	170,152,684	-	172,886,000	2,733,316
シンガポール・ドル	108,088,485	-	108,253,200	164,715
スイス・フラン	114,880,000	-	117,440,000	2,560,000
スウェーデン・クローナ	40,152,090	-	40,656,000	503,910
デンマーク・クローネ	28,939,094	-	29,358,100	419,006
ニュージーランド・ドル	16,096,300	-	16,214,000	117,700
ノルウェー・クローネ	6,921,998	-	6,997,400	75,402
メキシコ・ペソ	54,233,570	-	54,597,200	363,630
ユーロ	531,768,720	-	539,301,000	7,532,280
香港・ドル	787,904,100	-	786,496,500	1,407,600
南アフリカ・ランド	109,338,480	-	112,401,000	3,062,520
合計	12,903,930,576	-	12,902,562,400	1,368,176

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第7期 2020年6月11日現在	第8期 2020年12月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0437円 (10,437円)	1.0685円 (10,685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

2020年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	312回 利付国庫債券 (10年)	10,000,000,000	10,002,100,000	
	日本円 小計		10,000,000,000	10,002,100,000	
国債証券 合計			10,000,000,000	10,002,100,000	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	20,500.000	559,035.000	
	アメリカ・ドル 小計		20,500.000	559,035.000 (58,145,230)	
投資信託受益証券 合計			20,500	58,145,230 (58,145,230)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	844,171,990	3,664,719,442	
		外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	2,056,714,046	2,434,532,416	
		為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド	6,562,474,078	9,730,836,562	
		エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド	2,691,361,424	3,555,288,441	

	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,579,591,505	3,306,558,897	
	日本円 小計	13,734,313,043	22,691,935,758	
親投資信託受益証券 合計		13,734,313,043	22,691,935,758	
合計			32,752,180,988 (58,145,230)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.16	0.18

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,380,387,882
コール・ローン	272,633,706
株式	397,415,515,754
新株予約権証券	1,856,477
投資信託受益証券	794,287,743
投資証券	8,044,684,014
派生商品評価勘定	71,216,413
未収入金	745,562,067
未収配当金	529,300,497
差入委託証拠金	3,175,352,125
流動資産合計	413,430,796,678
資産合計	413,430,796,678
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,248,746
未払金	747,486,343
未払解約金	55,601,800
流動負債合計	806,336,889
負債合計	806,336,889
純資産の部	
元本等	
元本	95,048,377,388
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	317,576,082,401
元本等合計	412,624,459,789
純資産合計	412,624,459,789
負債純資産合計	413,430,796,678

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	94,084,228,570円
同期中追加設定元本額	20,883,432,189円
同期中一部解約元本額	19,919,283,371円

元本の内訳

ファンド名

DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,164,934,638円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,048,404円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,637,376円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,676,095円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,390,622円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,715,875円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,613,347円
たわらノーロード 先進国株式	18,316,314,183円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	189,251,566円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,300,989,307円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	380,082,279円
たわらノーロード バランス(堅実型)	42,529,745円
たわらノーロード バランス(標準型)	326,844,021円
たわらノーロード バランス(積極型)	383,398,206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)	846,925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)	118,760,973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)	277,663,579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)	213,471,822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)	329,409,905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)	331,338円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,750,015円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,764,408円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,968,359円
たわらノーロード 全世界株式	78,117,009円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	46,321,783,744円
One DC 先進国株式インデックスファンド	379,634,820円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	187,663,144円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	938,680,812円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,120,049,672円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	116,161,927円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	351,272,941円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	295,406,597円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	26,982,252円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	822,545,223円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	170,332,957円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	210,507,927円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	176,270,064円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	289,439,986円
投資のソムリエ	1,673,609,937円
クルーズコントロール	266,660,680円
投資のソムリエ<DC年金>	115,853,493円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	195,775,835円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	117,193,627円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,933,827円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,496,311円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	86,675,843円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	915,859,292円
ワールドアセットバランス(基本コース)	362,207,966円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	844,171,990円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,029,082円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,339,292円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	839,096円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	3,660,132円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	31,014,993円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	553,682,532円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	174,445,539円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	3,306,153円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,740,741円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,785,727円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,117,869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)	669,780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)	865,695円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	459,973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)	264,175,040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)	63,626,430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)	1,444,910,288円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,157,849,013円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	862,876,717円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	12,225,834円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,335,902円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	50,061,050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)	96,679,273円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,610,745円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	37,352,600円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,442,911円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,752,451円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	15,762,298円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	49,711,853円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	320,268,895円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	439,343,855円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,433,521,656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)	518,536,944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)	80,005,581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)	518,680,344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)	25,051,056円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	5,050,318円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	219,818,847円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	17,245,762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)	68,164,363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)	108,569,330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)	235,109,117円
計	95,048,377,388円

2. 受益権の総数

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2020年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2020年12月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	32,727,736,177	
新株予約権証券	228,257	
投資信託受益証券	120,053,034	
投資証券	1,036,587,681	
合計	31,570,867,205	

(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(2020年2月18日から2020年12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	738,025,792	-	738,123,200	97,408
カナダ・ドル	2,603,104	-	2,610,240	7,136
ユーロ	735,422,688	-	735,512,960	90,272
買建	882,081,402	-	881,875,970	205,432
アメリカ・ドル	104,553,110	-	104,312,000	241,110
イギリス・ポンド	755,117,613	-	755,092,470	25,143
オーストラリア・ドル	4,521,026	-	4,540,820	19,794
カナダ・ドル	1,386,928	-	1,386,690	238
ユーロ	16,502,725	-	16,543,990	41,265
合計	1,620,107,194	-	1,619,999,170	302,840

(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	2020年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		

市場取引 先物取引 買建	6,286,807,440	-	6,355,077,947	68,270,507
合計	6,286,807,440	-	6,355,077,947	68,270,507

(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)

	2020年12月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.3412円 (43,412円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2020年12月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	35,926	3,101.490	111,424,129.740	
	ABBOTT LABORATORIES	149,801	106.520	15,956,802.520	
	AES CORP	56,735	20.850	1,182,924.750	
	ABIOMED INC	3,574	267.930	957,581.820	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,521	124.960	9,437,104.160	
	ADVANCED MICRO DEVICES	98,091	91.660	8,991,021.060	
	ADOBE INC	40,386	476.870	19,258,871.820	
	CHUBB LTD	37,740	153.680	5,799,883.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,422	268.820	4,952,202.040	
	ALLEGHANY CORP	1,263	597.750	754,958.250	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	160.000	968,320.000	
	ALLSTATE CORP	26,342	105.420	2,776,973.640	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	59,490	211.970	12,610,095.300	
	AMGEN INC	49,267	228.160	11,240,758.720	
	HESS CORP	21,951	57.300	1,257,792.300	
	AMERICAN EXPRESS CO	57,244	121.840	6,974,608.960	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	41,980	82.480	3,462,510.400	
	AFLAC INC	58,283	45.350	2,643,134.050	
	AMERICAN INTL GROUP	72,425	39.710	2,875,996.750	
	AMERCO	929	431.130	400,519.770	
ANALOG DEVICES	30,783	141.280	4,349,022.240		

ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,098	118.870	2,151,309.260	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	62,634	45.690	2,861,747.460	
VALERO ENERGY CORP	34,554	59.870	2,068,747.980	
ANSYS INC	7,234	334.040	2,416,445.360	
APPLE INC	1,442,893	123.240	177,822,133.320	
APPLIED MATERIALS INC	78,202	87.890	6,873,173.780	
ALBEMARLE CORP	9,536	141.430	1,348,676.480	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,360	49.200	2,330,112.000	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	80.740	749,105.720	
AMEREN CORP	22,273	77.340	1,722,593.820	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	95.720	636,633.720	
AUTOLIV INC	7,570	92.060	696,894.200	
AUTODESK INC	18,325	281.160	5,152,257.000	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,986	172.000	6,189,592.000	
AUTOZONE INC	1,972	1,137.850	2,243,840.200	
AVERY DENNISON CORP	6,549	150.800	987,589.200	
BALL CORP	27,293	93.260	2,545,345.180	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	118,499	227.350	26,940,747.650	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,597	41.360	2,754,451.920	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,746	79.160	3,383,773.360	
BECTON DICKINSON & CO	24,739	242.330	5,995,001.870	
AMETEK INC	20,008	118.350	2,367,946.800	
VERIZON COMM INC	349,755	60.510	21,163,675.050	
WR BERKLEY CORP	12,511	64.840	811,213.240	
BEST BUY CO INC	19,639	103.030	2,023,406.170	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,859	554.780	1,031,336.020	
YUM! BRANDS INC	25,420	106.460	2,706,213.200	
FIRSTENERGY CORP	47,800	30.220	1,444,516.000	
BOEING CO	45,095	234.430	10,571,620.850	
ROBERT HALF INTL INC	11,111	64.130	712,548.430	
BORGWARNER INC	21,938	38.280	839,786.640	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,401	34.000	4,059,634.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	92.720	1,086,585.680	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,642	187.820	1,810,960.440	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,015	1,151.820	2,320,917.300	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	189,828	60.200	11,427,645.600	
ONEOK INC	36,226	41.750	1,512,435.500	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	89.920	530,528.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	241.980	1,495,678.380	
SEMPRA ENERGY	24,590	128.730	3,165,470.700	
FEDEX CORP	20,793	290.900	6,048,683.700	
VERISIGN INC	8,762	207.750	1,820,305.500	
AMPHENOL CORP	24,857	131.410	3,266,458.370	
BROWN-FORMAN CORP	26,085	76.150	1,986,372.750	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.390	620,699.040	
CSX CORP	64,187	90.000	5,776,830.000	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	17.650	554,492.400	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	47.310	664,705.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	64.820	1,273,129.620	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,036	207.290	2,909,522.440	
CARDINAL HEALTH INC	24,718	55.450	1,370,613.100	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	40,534	22.320	904,718.880	
CATERPILLAR INC	45,357	178.850	8,112,099.450	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	119.750	1,181,333.750	
CITRIX SYSTEMS INC	9,933	132.670	1,317,811.110	
CENTURYLINK INC	80,424	10.030	806,652.720	
CERNER CORP	25,177	73.970	1,862,342.690	
JPMORGAN CHASE & CO	257,801	120.270	31,005,726.270	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,287	85.330	1,816,419.710	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	80.970	1,042,245.840	
CINTAS CORP	7,465	347.350	2,592,967.750	
CISCO SYSTEMS INC	354,537	44.320	15,713,079.840	
CLOROX COMPANY	10,683	200.600	2,143,009.800	
COCA-COLA CO/THE	345,110	53.050	18,308,085.500	
COPART INC	17,304	114.750	1,985,634.000	
COGNEX CORP	14,677	76.260	1,119,268.020	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,311	84.590	5,778,427.490	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	23,920	131.770	3,151,938.400	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	204.690	1,065,002.070	
NRG ENERGY, INC.	21,039	33.910	713,432.490	
COMCAST CORP-CL A	385,078	50.480	19,438,737.440	
CONAGRA BRANDS INC	40,291	35.370	1,425,092.670	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,587	73.350	2,023,506.450	
CMS ENERGY CORP	25,936	59.440	1,541,635.840	
COOPER COS INC	4,523	347.800	1,573,099.400	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	48.210	796,091.730	
CORNING INC	64,157	37.170	2,384,715.690	
SEALED AIR CORP	13,870	45.400	629,698.000	
HEICO CORP-CL A	6,236	121.000	754,556.000	
CUMMINS INC	12,578	219.550	2,761,499.900	
DR HORTON INC	29,267	69.970	2,047,811.990	

DANAHER CORP	54,073	223.210	12,069,634.330	
MOODY'S CORP	13,994	273.980	3,834,076.120	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,078	78.380	3,533,213.640	
TARGET CORP	42,591	172.400	7,342,688.400	
DEERE & CO	24,809	253.450	6,287,841.050	
MORGAN STANLEY	113,219	64.440	7,295,832.360	
REPUBLIC SERVICES INC	19,136	93.490	1,789,024.640	
COSTAR GROUP INC	3,294	848.390	2,794,596.660	
THE WALT DISNEY CO	152,680	154.690	23,618,069.200	
DOLLAR TREE INC	20,057	108.290	2,171,972.530	
DOVER CORP	12,652	121.370	1,535,573.240	
OMNICOM GROUP	17,365	63.960	1,110,665.400	
DTE ENERGY CO	16,340	124.220	2,029,754.800	
DUKE ENERGY CORP	61,714	91.760	5,662,876.640	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,902	115.440	1,258,526.880	
EBAY INC	58,445	49.600	2,898,872.000	
BANK OF AMERICA CORP	660,162	29.110	19,217,315.820	
CITIGROUP INC	176,952	60.500	10,705,596.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,903	102.980	1,122,790.940	
EATON CORP PLC	33,610	115.150	3,870,191.500	
CADENCE DESIGN SYS INC	23,585	117.450	2,770,058.250	
DISH NETWORK CORP	21,420	36.210	775,618.200	
ECOLAB INC	21,930	223.080	4,892,144.400	
PERKINELMER INC	9,755	145.910	1,423,352.050	
ELECTRONIC ARTS INC	23,979	134.680	3,229,491.720	
SALESFORCE.COM INC	76,963	222.920	17,156,591.960	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	230.460	516,921.780	
EMERSON ELECTRIC CO	49,931	81.360	4,062,386.160	
ATMOS ENERGY CORP	9,937	98.170	975,515.290	
ENTERGY CORP	17,195	103.260	1,775,555.700	
EOG RESOURCES INC	50,062	54.680	2,737,390.160	
EQUIFAX INC	10,322	183.390	1,892,951.580	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,144	246.530	4,719,570.320	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	13,942	89.700	1,250,597.400	
EXXON MOBIL CORP	359,028	44.010	15,800,822.280	
FMC CORP	11,416	117.660	1,343,206.560	
NEXTERA ENERGY INC	166,332	73.280	12,188,808.960	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	348.690	1,131,847.740	
FAIR ISAAC CORP	2,482	506.910	1,258,150.620	
ASSURANT INC	4,594	132.520	608,796.880	
FASTENAL CO	47,962	48.390	2,320,881.180	
FIFTH THIRD BANCORP	58,016	27.780	1,611,684.480	
M&T BANK CORP	11,432	127.980	1,463,067.360	
FISERV INC	47,512	114.830	5,455,802.960	
FORD MOTOR CO	331,318	9.120	3,021,620.160	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	24.260	575,277.380	
FREEMPORT-MCMORAN INC	126,973	24.860	3,156,548.780	

ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,963	119.510	1,907,738.130	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	54.090	994,498.740	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,458	150.370	3,076,269.460	
GENERAL MILLS INC	50,541	58.870	2,975,348.670	
GENUINE PARTS CO	11,605	97.040	1,126,149.200	
GILEAD SCIENCES INC	106,388	60.450	6,431,154.600	
GARTNER INC	7,522	156.010	1,173,507.220	
MCKESSON CORP	13,579	177.680	2,412,716.720	
NVIDIA CORP	52,112	518.890	27,040,395.680	
GENERAL ELECTRIC CO	733,755	11.320	8,306,106.600	
VW GRAINGER INC	3,745	402.320	1,506,688.400	
HALLIBURTON CO	69,816	19.990	1,395,621.840	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,991	88.030	2,904,197.730	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,310	244.400	6,674,564.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,168	187.500	3,406,500.000	
HASBRO INC	11,383	88.680	1,009,444.440	
HENRY SCHEIN INC	11,516	71.310	821,205.960	
HEICO CORP	3,623	131.090	474,939.070	
HERSHEY FOODS CORP	12,450	149.700	1,863,765.000	
HP INC	119,285	23.170	2,763,833.450	
F5 NETWORKS INC	4,874	171.410	835,452.340	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,024	97.340	1,170,416.160	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	21.970	613,819.830	
HOLOGIC INC	21,939	76.250	1,672,848.750	
HOME DEPOT INC	91,018	264.810	24,102,476.580	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	77.760	1,266,554.880	
HORMEL FOODS CORP	26,254	46.600	1,223,436.400	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,899	21.800	935,198.200	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	277.810	809,260.530	
HUMANA INC	11,307	397.480	4,494,306.360	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	137.020	1,033,678.880	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	80,847	13.030	1,053,436.410	
BIOGEN INC	13,713	242.980	3,331,984.740	
IDEX CORP	6,154	191.870	1,180,767.980	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,927	202.550	5,454,063.850	
INTUIT INC	21,859	362.500	7,923,887.500	
IDEXX LABORATORIES INC	7,088	454.270	3,219,865.760	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	46.380	508,324.800	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,182	139.220	2,809,738.040	
INTEL CORP	359,405	50.260	18,063,695.300	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,206	112.590	811,323.540	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,983	48.640	1,555,653.120	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	23.640	834,893.880	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,033	108.710	1,199,397.430	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,050	153.840	930,732.000	
INCYTE CORP	15,942	82.050	1,308,041.100	
JOHNSON & JOHNSON	222,470	152.250	33,871,057.500	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,620	47.400	1,403,988.000	
KLA CORPORATION	12,667	255.980	3,242,498.660	
KELLOGG CO	21,954	61.980	1,360,708.920	
KEYCORP	87,597	16.080	1,408,559.760	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,127	134.060	3,904,765.620	
BLACKROCK INC/NEW YORK	12,773	698.410	8,920,790.930	
KROGER CO	65,605	31.210	2,047,532.050	
LAM RESEARCH CORP	12,392	490.150	6,073,938.800	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,302	391.790	1,293,690.580	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	135.560	1,143,855.280	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,153	103.410	1,463,561.730	
LENNAR CORP	23,570	72.290	1,703,875.300	
ELI LILLY & CO	72,340	161.000	11,646,740.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	52.650	807,861.600	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	59,835	164.240	9,827,300.400	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26,084	118.810	3,099,040.040	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,201	355.390	7,534,623.390	
LOEWS CORP	21,759	43.660	949,997.940	
LOWE'S COS INC	64,054	160.220	10,262,731.880	
DOMINION ENERGY INC	71,579	74.320	5,319,751.280	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	30.930	1,193,062.890	
MCCORMICK & CO INC	21,514	93.050	2,001,877.700	
MCDONALD'S CORPORATION	62,868	208.040	13,079,058.720	
S&P GLOBAL INC	20,168	325.830	6,571,339.440	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	235.820	805,561.120	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,027.810	1,234,399.810	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	51,562	86.740	4,472,487.880	
MARSH & MCLENNAN COS	42,507	115.370	4,904,032.590	
MASCO CORP	23,151	54.460	1,260,803.460	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,258	266.740	1,402,518.920	
METLIFE INC	64,392	47.550	3,061,839.600	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,874	84.520	1,848,790.480	
MEDTRONIC PLC	113,880	112.680	12,831,998.400	

ACTIVISION BLIZZARD INC	65,735	83.110	5,463,235.850	
CVS HEALTH CORP	109,529	72.210	7,909,089.090	
MERCK & CO. INC.	214,091	82.990	17,767,412.090	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	30.540	998,230.440	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,070	207.590	1,675,251.300	
MICROSOFT CORP	606,756	210.520	127,734,273.120	
MICRON TECH INC	92,874	71.280	6,620,058.720	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,681	139.910	2,893,478.710	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	57,179	42.910	2,453,550.890	
3M CO	48,271	173.490	8,374,535.790	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	132.980	661,708.480	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,255	171.860	2,449,864.300	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,737	194.950	1,508,328.150	
ILLUMINA INC	12,225	343.710	4,201,854.750	
XCEL ENERGY INC	43,530	65.180	2,837,285.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	91.240	735,211.920	
NETAPP INC	17,963	61.120	1,097,898.560	
NEWELL BRANDS INC	33,317	20.805	693,160.180	
NEWMONT CORP	68,379	59.180	4,046,669.220	
NVR INC	305	3,991.180	1,217,309.900	
NIKE INC-CL B	105,334	137.580	14,491,851.720	
NORDSON CORP	4,644	198.000	919,512.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,392	236.500	5,059,208.000	
EVERSOURCE ENERGY	28,269	85.690	2,422,370.610	
NISOURCE INC	31,427	22.570	709,307.390	
NORTHERN TRUST CORP	17,365	91.720	1,592,717.800	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,148	298.430	3,923,757.640	
WELLS FARGO & CO	332,238	29.490	9,797,698.620	
NUCOR CORP	25,118	57.110	1,434,488.980	
CHENIERE ENERGY INC	19,190	61.420	1,178,649.800	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,027	94.670	3,694,686.090	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,641	21.310	1,633,219.710	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,813	198.700	1,552,443.100	
OGE ENERGY CORP	16,028	32.340	518,345.520	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,256	446.000	2,790,176.000	
ORACLE CORP	168,897	59.480	10,045,993.560	
PACCAR INC	28,876	85.750	2,476,117.000	
PTC INC	9,433	112.660	1,062,721.780	
EXELON CORP	81,082	41.200	3,340,578.400	
PARKER HANNIFIN CORP	11,059	274.440	3,035,031.960	
PAYCHEX INC	27,450	91.340	2,507,283.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,181	508.390	3,142,358.590	

PPL CORPORATION	64,630	28.120	1,817,395.600	
PEPSICO INC	116,370	144.670	16,835,247.900	
PENTAIR PLC	12,511	51.120	639,562.320	
PFIZER INC	470,026	41.730	19,614,184.980	
ESSENTIAL UTILITIES INC	18,952	48.020	910,075.040	
CONOCOPHILLIPS	90,684	44.000	3,990,096.000	
PG&E CORP	123,999	12.020	1,490,467.980	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,898	118.790	1,650,943.420	
ALTRIA GROUP INC	155,809	42.950	6,691,996.550	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,537	143.990	5,116,972.630	
BROWN & BROWN INC	20,308	44.880	911,423.040	
GARMIN LTD	12,365	118.600	1,466,489.000	
PPG INDUSTRIES INC	19,812	143.330	2,839,653.960	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	206.920	693,802.760	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,416	372.790	13,948,310.640	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,161	149.340	2,861,503.740	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	125.470	1,365,490.010	
PROCTER & GAMBLE CO	210,355	135.510	28,505,206.050	
PROGRESSIVE CORP	49,891	94.200	4,699,732.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,278	56.600	2,392,934.800	
PULTE GROUP INC	21,209	42.160	894,171.440	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,956	194.170	4,845,706.520	
QUALCOMM INC	95,333	155.750	14,848,114.750	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	92.650	995,431.600	
EXACT SCIENCES CORP	12,799	132.890	1,700,859.110	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,052	164.250	665,541.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,892	478.980	4,259,090.160	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	122.140	744,687.580	
RESMED INC	12,197	208.730	2,545,879.810	
US BANCORP	113,752	46.120	5,246,242.240	
SEAGEN INC	10,296	186.550	1,920,718.800	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,383	34.270	1,178,305.410	
ROSS STORES INC	29,874	113.320	3,385,321.680	
ROLLINS INC	12,378	54.140	670,144.920	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,746	415.000	3,629,590.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,811	246.770	2,421,060.470	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,879	80.640	1,280,482.560	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	87.070	958,118.280	
ACCENTURE PLC-CL A	53,439	246.160	13,154,544.240	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	121,361	57.180	6,939,421.980	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,744	206.820	2,222,074.080	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,167	136.710	2,893,740.570	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	52,647	147.470	7,763,853.090	
BOOKING HOLDINGS INC	3,430	2,104.870	7,219,704.100	
SCHLUMBERGER LTD	118,219	23.380	2,763,960.220	
SCHWAB (CHARLES) CORP	127,865	50.100	6,406,036.500	
POOL CORP	3,532	331.400	1,170,504.800	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,440	145.990	2,546,065.600	
BUNGE LTD	13,304	64.500	858,108.000	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	56.810	605,196.930	
ANTHEM INC	21,162	313.750	6,639,577.500	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,641	99.370	1,256,136.170	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	49.820	1,104,758.500	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,848	719.820	4,929,327.360	
CENTENE CORP	48,565	61.310	2,977,520.150	
SVB FINANCIAL GROUP	4,532	353.730	1,603,104.360	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	56.310	639,174.810	
SNAP-ON INC	4,129	180.780	746,440.620	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,814	79.960	2,703,767.440	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	158.220	985,077.720	
EDISON INTERNATIONAL	31,683	62.880	1,992,227.040	
SOUTHERN CO	89,102	60.500	5,390,671.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	112,243	47.950	5,382,051.850	
SOUTHWEST AIRLINES	11,791	46.800	551,818.800	
AT&T INC	602,677	30.690	18,496,157.130	
CHEVRON CORP	162,830	93.350	15,200,180.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,127	177.640	2,331,880.280	
STATE STREET CORP	29,758	71.730	2,134,541.340	
STARBUCKS CORP	97,667	105.390	10,293,125.130	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	39.610	695,036.670	
STRYKER CORP	28,236	235.130	6,639,130.680	
NETFLIX INC	37,238	501.090	18,659,589.420	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	19.520	955,601.600	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	41.380	405,234.340	
SYNOPSIS INC	12,716	234.170	2,977,705.720	
SYSCO CORP	40,230	77.240	3,107,365.200	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,960	758.070	7,550,377.200	
TELEFLEX INC	4,002	383.350	1,534,166.700	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	10.570	933,563.540	
TERADYNE INC	14,284	115.680	1,652,373.120	
TEXAS INSTRUMENTS INC	76,972	162.000	12,469,464.000	

TEXTRON INC	19,486	48.030	935,912.580	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,469	468.740	15,688,259.060	
TIFFANY & CO	8,733	131.250	1,146,206.250	
GLOBE LIFE INC	8,088	94.880	767,389.440	
DAVITA INC	6,497	111.910	727,079.270	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	135.950	1,301,449.350	
TRIMBLE INC	20,073	62.380	1,252,153.740	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,473	449.590	1,561,426.070	
TYSON FOODS INC	24,980	69.410	1,733,861.800	
UGI CORP	16,326	35.450	578,756.700	
UNION PACIFIC CORP	57,642	202.520	11,673,657.840	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	129,750	72.980	9,469,155.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,435	339.650	27,319,747.750	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	135.370	832,931.610	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	174.880	1,263,682.880	
VF CORP	28,712	86.900	2,495,072.800	
VIACOMCBS INC	45,361	35.870	1,627,099.070	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,766	224.040	4,876,454.640	
VULCAN MATERIALS CO	11,057	137.760	1,523,212.320	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,849	41.650	2,617,660.850	
WALMART INC	118,990	147.040	17,496,289.600	
WASTE MANAGEMENT INC	36,101	114.940	4,149,448.940	
WATERS CORP	5,211	241.560	1,258,769.160	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,271	266.670	1,672,287.570	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	115.870	1,063,223.120	
VAIL RESORTS INC	3,109	291.440	906,086.960	
WESTERN DIGITAL CORP	25,867	51.610	1,334,995.870	
WABTEC CORP	16,257	75.400	1,225,777.800	
WHIRLPOOL CORP	5,029	182.410	917,339.890	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,165	145.540	2,061,574.100	
WYNN RESORTS LTD	8,639	112.880	975,170.320	
NASDAQ INC	10,097	124.990	1,262,024.030	
CME GROUP INC	30,562	182.480	5,576,953.760	
WILLIAMS COS INC	102,608	22.000	2,257,376.000	
LKQ CORP	23,691	36.570	866,379.870	
ALLIANT ENERGY CORP	22,829	51.860	1,183,911.940	
WEC ENERGY GROUP INC	26,631	91.980	2,449,519.380	
CARMAX INC	14,209	94.340	1,340,477.060	
XILINX INC	20,586	143.860	2,961,501.960	
TJX COMPANIES INC	100,155	66.520	6,662,310.600	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,561	375.140	1,711,013.540	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.320	469,584.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,800	54.560	971,168.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	25.790	441,009.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,381	126.050	1,182,475.050	
CBRE GROUP INC	29,617	66.330	1,964,495.610	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	24.150	307,477.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	77,232	15.850	1,224,127.200	
DOMINO'S PIZZA INC	3,212	386.050	1,239,992.600	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,737	307.270	1,148,267.990	
T-MOBILE US INC	46,391	130.560	6,056,808.960	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,755	57.300	1,590,361.500	
MOSAIC CO/THE	28,249	22.250	628,540.250	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,209	551.580	1,770,020.220	
CELANESE CORP	9,803	130.970	1,283,898.910	
DEXCOM INC	8,162	347.190	2,833,764.780	
DISCOVERY INC-A	10,423	28.790	300,078.170	
EXPEDIA GROUP INC	11,508	130.470	1,501,448.760	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	39.110	722,557.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,614	192.850	2,046,909.900	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	23.200	789,333.600	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,643	109.240	5,095,281.320	
LIVE NATION	13,804	72.330	998,443.320	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,229	1,317.230	2,936,105.670	
TRANSDIGM GROUP INC	4,416	601.010	2,654,060.160	
MASTERCARD INC	75,542	331.520	25,043,683.840	
WESTERN UNION CO	35,367	21.890	774,183.630	
OWENS CORNING	8,324	75.240	626,297.760	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,057	104.820	1,158,994.740	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	18.910	328,088.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,959	146.220	1,456,204.980	
DELTA AIR LINES INC	14,723	42.620	627,494.260	
INSULET CORP	5,566	246.970	1,374,635.020	
DISCOVER FINANCIAL	24,889	84.160	2,094,658.240	
TE CONNECTIVITY LTD	27,872	118.470	3,301,995.840	
MASIMO CORP	4,505	270.450	1,218,377.250	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	16,401	63.960	1,049,007.960	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,304	369.070	3,802,897.280	

VMWARE INC	6,532	141.840	926,498.880	
MERCADOLIBRE INC	3,718	1,589.520	5,909,835.360	
ULTA BEAUTY INC	4,538	272.130	1,234,925.940	
INVESCO LTD	33,443	17.510	585,586.930	
MSCI INC	7,090	422.600	2,996,234.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	130,662	84.970	11,102,350.140	
VISA INC	142,567	207.610	29,598,334.870	
KEURIG DR PEPPER INC	48,480	30.180	1,463,126.400	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,412	148.070	2,282,054.840	
DISCOVERY INC-C	30,421	25.480	775,127.080	
MARATHON PETROLEUM CORP	55,102	43.830	2,415,120.660	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,744	83.940	985,791.360	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	172,897	14.790	2,557,146.630	
XYLEM INC	15,151	98.210	1,487,979.710	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	22,598	88.210	1,993,369.580	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	174.460	607,818.640	
SPLUNK INC	13,312	153.490	2,043,258.880	
EPAM SYSTEMS INC	4,783	322.760	1,543,761.080	
ZILLOW GROUP INC	5,366	123.650	663,505.900	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	47.530	704,109.420	
HCA HEALTHCARE INC	22,479	161.790	3,636,877.410	
VERISK ANALYTICS INC	12,967	192.200	2,492,257.400	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	146.710	626,891.830	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,095	273.390	1,939,702.050	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,975	130.320	1,821,222.000	
NXP SEMICONDUCTOR NV	23,392	158.270	3,702,251.840	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	87.640	1,022,495.880	
LEAR CORP	4,681	156.290	731,593.490	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	86.940	749,596.680	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,243	72.130	1,460,127.590	
DOLLAR GENERAL CORP	20,975	205.870	4,318,123.250	
FORTINET INC	10,939	127.560	1,395,378.840	
HORIZON PHARMA PLC	18,986	73.550	1,396,420.300	
TESLA INC	62,949	627.070	39,473,429.430	
GENERAC HOLDINGS INC	5,402	211.270	1,141,280.540	
ENPHASE ENERGY INC	10,163	131.210	1,333,487.230	
GENERAL MOTORS CO	108,381	42.870	4,646,293.470	
XPO LOGISTICS INC	7,614	120.200	915,202.800	

ALLY FINANCIAL INC	30,122	34.490	1,038,907.780	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	58.840	604,463.320	
APTIV PLC	22,755	124.150	2,825,033.250	
PHILLIPS 66	37,121	70.860	2,630,394.060	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	121.840	873,836.480	
FACEBOOK INC	203,005	277.120	56,256,745.600	
IQVIA HOLDINGS INC	16,071	168.470	2,707,481.370	
SERVICENOW INC	16,258	538.000	8,746,804.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,043	307.870	2,476,198.410	
WORKDAY INC	14,623	218.290	3,192,054.670	
ABBVIE INC	149,126	107.490	16,029,553.740	
ZOETIS INC	39,683	158.120	6,274,675.960	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	18.350	555,326.050	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	55.860	786,229.500	
CDW CORP	11,563	131.710	1,522,962.730	
HOWMET AEROSPACE INC	30,749	26.130	803,471.370	
TWILIO INC	11,117	334.510	3,718,747.670	
COUPA SOFTWARE INC	5,637	314.660	1,773,738.420	
SNAP INC	75,279	53.150	4,001,078.850	
TRADE DESK INC A	3,466	917.580	3,180,332.280	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	19,546	43.010	840,673.460	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	42.170	351,023.080	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	42.130	598,456.650	
OKTA INC	9,766	247.790	2,419,917.140	
BLACK KNIGHT INC	13,042	87.080	1,135,697.360	
BAKER HUGHES CO	57,274	23.120	1,324,174.880	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	76.390	1,006,896.590	
ALTICE USA INC-A	28,646	34.890	999,458.940	
BROADCOM INC	34,036	410.040	13,956,121.440	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,207	346.380	2,149,980.660	
MONGODB INC	4,188	319.060	1,336,223.280	
BURLINGTON STORES INC	5,602	233.100	1,305,826.200	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	28.800	1,031,731.200	
VEEVA SYSTEMS INC	11,332	265.050	3,003,546.600	
TWITTER INC	66,138	51.210	3,386,926.980	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	49.640	655,942.960	
EVERGY INC	18,388	55.100	1,013,178.800	
ALLEGION PLC	7,469	110.650	826,444.850	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,454	96.980	1,110,808.920	
STERIS PLC	7,390	189.760	1,402,326.400	
DOCUSIGN INC	14,553	222.590	3,239,352.270	
WIX.COM LTD	4,454	271.780	1,210,508.120	
DROPBOX INC	28,170	21.240	598,330.800	
KKR & CO INC	43,097	39.010	1,681,213.970	
PERRIGO CO PLC	10,553	48.760	514,564.280	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	14,630	397.960	5,822,154.800	

MODERNA INC	23,007	155.690	3,581,959.830	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	24,001	107.360	2,576,747.360	
ARAMARK	18,632	38.060	709,133.920	
CIGNA CORP	30,953	212.650	6,582,155.450	
DELL TECHNOLOGIES INC	20,586	72.160	1,485,485.760	
DOW INC	61,890	54.430	3,368,672.700	
AMCOR PLC	130,000	11.530	1,498,900.000	
PINTEREST INC	39,407	71.640	2,823,117.480	
PELOTON INTERACTIVE INC	16,480	117.990	1,944,475.200	
FOX CORP-A	31,751	29.110	924,271.610	
FOX CORP-B	13,009	28.685	373,163.160	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	12,052	179.990	2,169,239.480	
CHEWY INC	6,586	78.070	514,169.020	
AVANTOR INC	44,509	26.820	1,193,731.380	
DYNATRACE INC	15,949	38.710	617,385.790	
CLOUDFLARE INC	13,218	84.050	1,110,972.900	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	64.710	457,176.150	
CARRIER GLOBAL CORP	69,248	37.540	2,599,569.920	
OTIS WORLDWIDE CORP	34,448	64.000	2,204,672.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	79,977	54.350	4,346,749.950	
CORTEVA INC	62,843	38.740	2,434,537.820	
MATCH GROUP INC	20,510	147.320	3,021,533.200	
SLACK TECHNOLOGIES INC	32,512	42.320	1,375,907.840	
BLACKSTONE GROUP INC	55,746	62.850	3,503,636.100	
CARLYLE GROUP INC	12,509	29.720	371,767.480	
10X GENOMICS INC	5,312	149.460	793,931.520	
DATADOG INC	13,021	101.530	1,322,022.130	
INGERSOLL RAND INC	28,361	44.790	1,270,289.190	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,330	426.990	1,848,866.700	
PPD INC	10,828	35.130	380,387.640	
AON PLC	19,716	206.240	4,066,227.840	
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	148.660	946,072.240	
ZENDESK INC	10,021	137.510	1,377,987.710	
ROYALTY PHARMA PLC	10,361	45.200	468,317.200	
VIATRIS INC	102,403	17.690	1,811,509.070	
DRAFTKINGS INC	14,671	50.110	735,163.810	
SNOWFLAKE INC	2,805	373.280	1,047,050.400	
ARISTA NETWORKS INC	5,042	276.370	1,393,457.540	
IHS MARKIT LTD	32,101	89.710	2,879,780.710	
FNF GROUP	21,372	37.080	792,473.760	
CATALENT INC	13,173	95.180	1,253,806.140	
SYNCHRONY FINANCIAL	45,491	32.980	1,500,293.180	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,959	36.000	1,258,524.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	107.630	372,076.910	
WAYFAIR INC	5,543	244.260	1,353,933.180	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,869	124.760	1,979,816.440	

	HUBSPOT INC	3,741	395.140	1,478,218.740	
	QORVO INC	10,168	158.330	1,609,899.440	
	LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,947	158.900	468,278.300	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	161.400	1,340,749.800	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	28.600	486,714.800	
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	4,257	273.480	1,164,204.360	
	GODADDY INC	14,540	84.480	1,228,339.200	
	ETSY INC	10,237	165.300	1,692,176.100	
	TRANSUNION	16,760	95.350	1,598,066.000	
	SQUARE INC	31,463	217.250	6,835,336.750	
	DUPONT DE NEMOURS INC	61,404	66.570	4,087,664.280	
	CARVANA CO	5,347	260.470	1,392,733.090	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	18,296	47.410	867,413.360	
	TELADOC HEALTH INC	9,773	199.010	1,944,924.730	
	WESTROCK CO	22,778	43.910	1,000,181.980	
	KRAFT HEINZ CO	56,879	34.100	1,939,573.900	
	NOVOCURE LTD	7,408	168.180	1,245,877.440	
	FORTIVE CORP	25,981	68.930	1,790,870.330	
	WASTE CONNECTIONS INC	22,342	101.880	2,276,202.960	
	ALPHABET INC-CL A	25,277	1,767.650	44,680,889.050	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	105,599	12.120	1,279,859.880	
	PAYPAL HOLDINGS INC	94,303	215.340	20,307,208.020	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	26.430	932,371.110	
	SUNRUN INC	10,000	57.580	575,800.000	
	ZILLOW GROUP INC-C	12,061	121.090	1,460,466.490	
	ALPHABET INC-CL C	25,431	1,775.330	45,148,417.230	
	ZSCALER INC	6,193	179.750	1,113,191.750	
	CABLE ONE INC	392	2,116.870	829,813.040	
	LINDE PLC	44,547	250.950	11,179,069.650	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	43.340	513,448.980	
	ROKU INC	8,597	321.990	2,768,148.030	
	AVALARA INC	6,312	165.340	1,043,626.080	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,030	658.040	7,916,221.200	
	VISTRA CORP	38,032	18.820	715,762.240	
アメリカ・ドル	小計	26,277,547		2,728,007,753.160 (283,740,086,407)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	14.640	465,522.720	
	ASHTED GROUP	38,916	32.700	1,272,553.200	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	23.260	510,161.580	
	BHP GROUP PLC	176,526	19.776	3,490,978.170	
	BARCLAYS PLC	1,493,804	1.417	2,116,720.260	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	5.986	492,546.030	
BT GROUP PLC	723,199	1.357	981,381.040	
BUNZL PLC	28,834	24.200	697,782.800	
AVIVA PLC	318,596	3.238	1,031,613.840	
CRODA INTERNATIONAL	12,568	63.100	793,040.800	
DIAGEO PLC	198,891	30.020	5,970,707.820	
SCHRODERS PLC	11,354	31.850	361,624.900	
DCC PLC	7,898	54.600	431,230.800	
NATIONAL GRID PLC	290,859	8.900	2,588,645.100	
KINGFISHER PLC	165,680	2.632	436,069.760	
BAE SYSTEMS PLC	273,749	5.112	1,399,404.880	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	194,304	29.240	5,681,448.960	
HALMA PLC	31,901	23.200	740,103.200	
NEXT PLC	11,467	66.500	762,555.500	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,235	15.760	1,232,983.600	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	24.340	365,513.780	
ANGLO AMERICAN PLC	107,554	25.010	2,689,925.540	
COMPASS GROUP PLC	149,561	14.585	2,181,347.180	
HSBC HOLDINGS PLC	1,709,168	4.031	6,889,656.200	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	514,692	2.491	1,282,097.770	
UNILEVER PLC	220,637	43.950	9,696,996.150	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.817	418,295.200	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	9.306	507,056.020	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.758	546,478.910	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	22.710	707,779.860	
PEARSON PLC	65,009	6.648	432,179.830	
PERSIMMON PLC	28,126	25.140	707,087.640	
PRUDENTIAL PLC	217,400	12.980	2,821,852.000	
RIO TINTO PLC	93,813	55.250	5,183,168.250	
VODAFONE GROUP PLC	2,224,388	1.337	2,974,006.750	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	59,219	65.900	3,902,532.100	
RELX PLC	165,948	18.215	3,022,742.820	
RENTOKIL INITIAL PLC	146,366	4.995	731,098.170	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	670,969	1.270	852,130.630	
NATWEST GROUP PLC	423,054	1.611	681,539.990	
ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	10.870	541,206.430	
SSE PLC	88,646	14.205	1,259,216.430	
BP PLC	1,733,483	2.847	4,935,226.100	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	5.728	498,971.800	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.585	494,356.200	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	112.450	739,246.300	

STANDARD CHARTERED PLC	220,443	4.777	1,053,056.210	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,109,041	0.356	2,174,818.590	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.533	531,635.200	
TESCO PLC	816,229	2.306	1,882,224.070	
3I GROUP PLC	77,445	11.290	874,354.050	
SMITH & NEPHEW PLC	76,928	15.430	1,186,999.040	
GLAXOSMITHKLINE PLC	420,949	14.174	5,966,531.120	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,272	86.780	2,279,884.160	
WPP PLC	111,598	7.724	861,982.950	
ASTRAZENECA PLC	111,291	81.030	9,017,909.730	
WHITBREAD PLC	18,594	30.650	569,906.100	
INTERTEK GROUP PLC	13,842	58.040	803,389.680	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	17.815	564,486.090	
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,315	47.840	636,989.600	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.252	309,008.180	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	28.540	453,586.220	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,581	42.310	489,992.110	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	346,240	14.348	4,967,851.520	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	309,765	13.852	4,290,864.780	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,010	25.590	332,925.900	
AVEVA GROUP PLC	10,408	32.560	338,884.480	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.791	575,819.580	
EXPERIAN PLC	75,976	27.430	2,084,021.680	
MONDI PLC	39,767	17.430	693,138.810	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	14.630	409,800.930	
FRESNILLO PLC NPR	17,385	11.400	198,189.000	
OCADO GROUP PLC	39,210	21.590	846,543.900	
INFORMA PLC	120,480	5.624	677,579.520	
GLENCORE PLC	836,468	2.390	1,999,158.520	
ENTAIN PLC	49,618	10.550	523,469.900	
EVRAZ PLC	48,765	4.511	219,978.910	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.961	333,686.930	
COCA-COLA HBC AG	15,208	23.280	354,042.240	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,721	7.150	369,805.150	
FERGUSON PLC	18,896	85.500	1,615,608.000	
M&G PLC	204,940	1.899	389,181.060	
JD SPORTS FASHION PLC	32,086	7.862	252,260.130	
AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.546	423,426.000	
MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.590	675,233.250	
イギリス・ポンド 小計	25,034,868		138,747,006.300 (19,185,936.031)	

イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,359	21.830	2,234,496.970	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	19.430	2,539,559.290	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	384.000	675,840.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	11.620	1,186,797.080	
	ICL GROUP LTD	49,411	15.460	763,894.060	
	NICE LTD	5,535	775.000	4,289,625.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	71.450	746,223.800	
	AZRIELI GROUP	2,291	194.900	446,515.900	
イスラエル・シュケル 小計		404,637		12,882,952.100 (411,610,320)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	64.190	1,081,858.260	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	235,974	23.170	5,467,517.580	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	304,650	19.990	6,089,953.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,206	22.510	3,201,057.060	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.040	1,107,803.360	
	AMP LTD	302,414	1.740	526,200.360	
	ASX LTD	15,573	76.770	1,195,539.210	
	BHP GROUP LTD	247,453	42.480	10,511,803.440	
	AMPOL LTD	20,946	30.500	638,853.000	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	14.450	549,678.000	
	CSL LIMITED	38,115	301.290	11,483,668.350	
	REA GROUP LTD	4,119	144.160	593,795.040	
	TRANSURBAN GROUP	230,892	13.830	3,193,236.360	
	COCA-COLA AMATIL LTD	52,693	12.760	672,362.680	
	COCHLEAR LTD	5,533	207.460	1,147,876.180	
	ORIGIN ENERGY LTD	132,860	5.070	673,600.200	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	149,393	83.090	12,413,064.370	
	RIO TINTO LIMITED	31,595	115.390	3,645,747.050	
	APA GROUP	94,106	10.370	975,879.220	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	30.530	1,578,920.010	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	5.150	1,159,677.000	
	TPG TELECOM LTD	28,719	7.510	215,679.690	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,839	36.790	1,465,676.810	
	ORICA LTD	41,311	15.850	654,779.350	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	26.830	233,662.470	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	14.090	875,214.440	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	17.310	639,448.710	
SYDNEY AIRPORT	116,056	6.640	770,611.840		
MACQUARIE GROUP LTD	29,821	139.150	4,149,592.150		
SUNCORP GROUP LTD	117,454	10.150	1,192,158.100		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	282,507	23.540	6,650,214.780	
	NEWCREST MINING LTD	66,127	27.080	1,790,719.160	
	OIL SEARCH LTD	197,895	3.730	738,148.350	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	5.160	321,375.120	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117,359	9.880	1,159,506.920	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	63,404	12.270	777,967.080	
	SANTOS LTD	132,862	6.500	863,603.000	
	SONIC HEALTHCARE	40,148	32.950	1,322,876.600	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	30.130	253,272.780	
	TABCORP HOLDINGS LTD	205,649	3.920	806,144.080	
	WESFARMERS LTD	95,839	50.140	4,805,367.460	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	22.730	1,959,235.080	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	106,718	39.510	4,216,428.180	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	55.500	554,722.500	
	SEEK LTD	25,899	26.820	694,611.180	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.850	305,372.100	
	AGL ENERGY LTD	49,076	13.450	660,072.200	
	BRAMBLES LTD	127,166	10.980	1,396,282.680	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	9.750	320,394.750	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.890	689,313.960	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	4.290	644,143.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	9.090	524,193.030	
	XERO LTD	10,498	139.510	1,464,575.980	
	AFTERPAY LTD	18,322	96.180	1,762,209.960	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	2.840	587,624.400	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	2.610	1,076,220.450	
	COLES GROUP LTD	109,456	18.080	1,978,964.480	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	30.400	243,200.000	
	オーストラリア・ドル 小計	6,175,455		116,671,673.550 (9,135,392,039)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,578	90.370	1,859,633.860	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	72,789	43.970	3,200,532.330	
	BARRICK GOLD CORP	148,244	29.380	4,355,408.720	
	ATCO LTD	7,193	38.600	277,649.800	
	BANK OF MONTREAL	53,729	97.510	5,239,114.790	
	BANK OF NOVA SCOTIA	100,955	68.290	6,894,216.950	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,132	72.400	2,109,156.800	
	BCE INC	14,959	58.460	874,503.140	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	109,524	54.010	5,915,391.240	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	26.660	751,598.720	
	SAPUTO INC	18,601	37.730	701,815.730	

BLACKBERRY LTD	39,652	10.650	422,293.800	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	46,369	20.440	947,782.360	
CGI INC	19,859	95.490	1,896,335.910	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	59.800	678,132.000	
CAE INC	25,006	32.010	800,442.060	
CAMECO CORP	32,627	15.850	517,137.950	
ROGERS COMM-CL B	31,543	60.760	1,916,552.680	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,542	111.770	4,196,069.340	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,758	31.950	3,219,218.100	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	166.090	807,529.580	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	32.140	293,084.660	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	59,874	140.100	8,388,347.400	
YAMANA GOLD INC	84,317	7.150	602,866.550	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	35.760	568,977.360	
OPEN TEXT CORP	21,795	58.480	1,274,571.600	
EMPIRE CO LTD	15,093	34.940	527,349.420	
KINROSS GOLD CORP	99,741	9.320	929,586.120	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	92.190	918,488.970	
FORTIS INC	38,963	52.740	2,054,908.620	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,694	20.540	1,020,714.760	
TELUS CORP	31,890	25.570	815,427.300	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	29.350	741,087.500	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	25.550	550,398.100	
ENBRIDGE INC	172,385	43.550	7,507,366.750	
IGM FINANCIAL INC	6,069	35.220	213,750.180	
MANULIFE FINANCIAL CORP	162,090	23.010	3,729,690.900	
LOBLAW CO LTD	15,136	65.210	987,018.560	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,678	79.480	1,881,927.440	
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,404	57.070	2,762,416.280	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	450.070	932,545.040	
METRO INC	20,760	58.900	1,222,764.000	
EMERA INC	22,433	54.310	1,218,336.230	
ONEX CORP	6,646	74.000	491,804.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	38.380	720,239.080	
POWER CORP OF CANADA	46,551	29.920	1,392,805.920	
QUEBECOR INC-B	16,042	32.400	519,760.800	
ROYAL BANK OF CANADA	119,582	106.440	12,728,308.080	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,496	432.330	4,970,065.680	
SHAW COMM INC-B	43,484	23.310	1,013,612.040	
SUNCOR ENERGY INC	130,806	23.930	3,130,187.580	
LUNDIN MINING CORP	43,480	9.930	431,756.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	23.320	956,493.120	

THOMSON REUTERS CORP	15,049	102.450	1,541,770.050	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	92.870	688,816.790	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	151,245	72.350	10,942,575.750	
TC ENERGY CORP	78,459	58.290	4,573,375.110	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	98.690	610,298.960	
INTACT FINANCIAL CORP	12,515	152.750	1,911,666.250	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,085	52.080	1,879,306.800	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,731	1,652.900	2,861,169.900	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,165	167.370	2,705,536.050	
B2GOLD CORP	101,675	7.110	722,909.250	
CI FINANCIAL CORP	20,285	16.480	334,296.800	
KEYERA CORP	16,668	24.030	400,532.040	
PARKLAND CORP	10,583	41.600	440,252.800	
ALTAGAS LTD	23,944	19.350	463,316.400	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,740	34.600	1,513,404.000	
DOLLARAMA INC	23,536	54.460	1,281,770.560	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	7.870	635,274.270	
NORTHLAND POWER INC	17,568	43.740	768,424.320	
TMX GROUP LTD	5,058	125.610	635,335.380	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	21,840	51.980	1,135,243.200	
INTER PIPELINE LTD	41,863	13.670	572,267.210	
NUTRIEN LTD	47,550	62.630	2,978,056.500	
SSR MINING INC	18,000	24.070	433,260.000	
WSP GLOBAL INC	10,194	120.730	1,230,721.620	
IA FINANCIAL CORP INC	8,104	58.200	471,652.800	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	35.670	588,019.950	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	7,230	89.270	645,422.100	
AIR CANADA	10,722	26.430	283,382.460	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	78.490	1,976,064.240	
SHOPIFY INC	9,164	1,359.930	12,462,398.520	
FIRSTSERVICE CORP	3,503	166.200	582,198.600	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	34.830	649,022.220	
HYDRO ONE LTD	27,340	28.800	787,392.000	
カナダ・ドル 小計	3,321,935		172,782,305.200 (14,095,580,458)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.840	480,000.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	155,700	25.050	3,900,285.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.850	285,740.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.020	621,478.000	
CAPITALAND LTD	204,515	3.180	650,357.700	
GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.840	358,512.000	
KEPPEL CORP LTD	134,900	5.230	705,527.000	

	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	271,653	10.030	2,724,679.590	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	676,822	2.340	1,583,763.480	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	160,850	4.350	699,697.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	22.790	2,333,696.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.510	304,155.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	19.100	401,100.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	4.200	597,660.000	
	シンガポール・ドル 小計	2,567,740		15,646,651.270 (1,219,656,466)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	208,841	11.350	2,370,345.350	
	LOGITECH INTL-REG	14,429	79.260	1,143,642.540	
	NESTLE SA-REGISTERED	243,473	99.900	24,322,952.700	
	CIE FINANC RICHEMONT	43,922	75.320	3,308,205.040	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	59,521	305.900	18,207,473.900	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	244.900	849,068.300	
	SIKA INHABER	11,880	229.000	2,720,520.000	
	SGS SA-REG	492	2,589.000	1,273,788.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	186,615	81.300	15,171,799.500	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	153.800	655,034.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	2,014.000	533,710.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	18.045	360,521.050	
	SWISSCOM AG-REG	2,159	477.400	1,030,706.600	
	ABB LTD	152,415	23.950	3,650,339.250	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	54.960	711,402.240	
	GEBERIT AG	3,181	525.800	1,672,569.800	
	LONZA GROUP AG-REG	6,246	543.400	3,394,076.400	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	8,255.000	784,225.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	85,800.000	772,200.000	
	GIVAUDAN-REG	768	3,618.000	2,778,624.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,545	365.700	4,587,706.500	
	LAFARGEHOLCIM LTD	43,996	46.600	2,050,213.600	
	TEMENOS GROUP	5,723	118.100	675,886.300	
	SONOVA HOLDING AG	4,698	222.600	1,045,774.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,518	196.500	887,787.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	1,030.500	947,029.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,441	230.400	562,406.400	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	44.640	204,986.880	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	241.000	400,783.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,761	403.000	1,112,683.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	94.900	237,250.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	133.400	462,231.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	812.500	514,312.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.050	515,439.500	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,515	981.800	1,487,427.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	50.360	898,875.640	
	SWISS RE LTD	24,871	81.640	2,030,468.440	
	ALCON INC	41,312	57.100	2,358,915.200	
	UBS GROUP AG	306,864	12.560	3,854,211.840	
スイス・フラン	小計	1,463,815		110,545,591.970 (12,979,157,953)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	53,126	429.100	22,796,366.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	374.200	13,490,284.200	
	ERICSSON LM-B SHS	245,215	104.500	25,624,967.500	
	LUNDBERGS B	7,382	432.800	3,194,929.600	
	SKF AB-B SHS	34,849	213.700	7,447,231.300	
	SANDVIK AB	93,940	195.150	18,332,391.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	89.700	11,735,181.900	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	206.500	6,536,344.500	
	SWEDBANK AB	71,958	157.280	11,317,554.240	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	140.050	7,414,947.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,411	84.980	10,742,406.780	
	VOLVO AB-B SHS	121,239	191.750	23,247,578.250	
	SWEDISH MATCH AB	13,845	650.000	8,999,250.000	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	112.850	5,310,156.750	
	INDUSTRIVARDEN A	11,955	270.800	3,237,414.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	261.000	2,976,183.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	202.000	3,876,582.000	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	136.250	3,283,352.500	
	INVESTOR AB-B SHS	37,641	589.400	22,185,605.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	68,814	186.150	12,809,726.100	
	ASSA ABLOY AB-B	87,021	204.900	17,830,602.900	
	TELIA CO AB	210,477	35.130	7,394,057.010	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	228.600	3,369,335.400	
	BOLIDEN AB	21,855	288.000	6,294,240.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	220.500	5,147,131.500	
	KINNEVIK AB-B	21,722	390.450	8,481,354.900	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	431.700	3,871,053.900	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	413.500	3,725,221.500	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	100.700	3,392,784.400	
	NIBE INDUSTRIER AB	23,117	254.800	5,890,211.600	
	HEXAGON AB	24,223	695.000	16,834,985.000	
	EPIROC AB-A	60,750	146.700	8,912,025.000	
	EPIROC AB-B	30,899	138.700	4,285,691.300	
	ESSITY AB-B	52,143	271.800	14,172,467.400	
	EQT AB	20,934	194.950	4,081,083.300	
	EVOLUTION GAMING GROUP AB	13,641	778.000	10,612,698.000	

	NORDEA BANK ABP	273,625	73.730	20,174,371.250	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	185.000	2,764,825.000	
スウェーデン・クローナ 小計		2,184,700		371,792,592.230 (4,580,484,736)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,656	943.000	8,162,608.000	
	A P MOLLER A/S	568	12,785.000	7,261,880.000	
	AP MOLLER MAERSK A	255	12,000.000	3,060,000.000	
	DANSKE BANK A/S	59,305	100.100	5,936,430.500	
	GENMAB A/S	5,641	2,395.000	13,510,195.000	
	NOVOZYMES-B SHS	17,740	343.400	6,091,916.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,148.000	1,746,324.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	144,558	425.550	61,516,656.900	
	GN STORE NORD A/S	10,133	487.100	4,935,784.300	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16,538	1,223.000	20,225,974.000	
	COLOPLAST-B	9,511	918.400	8,734,902.400	
	DSV PANALPINA A S	17,560	986.000	17,314,160.000	
	DEMANT A/S	7,244	222.900	1,614,687.600	
	H LUNDBECK A/S	4,840	196.450	950,818.000	
	TRYG A/S	11,107	175.200	1,945,946.400	
	PANDORA A/S	8,251	615.200	5,076,015.200	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	605.600	5,653,881.600	
	AMBU A/S B	14,156	206.200	2,918,967.200	
ORSTED A/S	15,500	1,072.500	16,623,750.000		
デンマーク・クローネ 小計		361,712		193,280,897.100 (3,279,976,824)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	8.200	903,853.200	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	14.900	445,420.600	
	A2 MILK CO LTD	55,091	14.000	771,274.000	
	FISHER & PAYKEL	49,044	31.790	1,559,108.760	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.535	723,890.300	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.750	416,704.500	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	6.890	855,476.180	
ニュージーランド・ドル 小計		589,774		5,675,727.540 (418,471,392)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	179.000	6,297,757.000	
	DNB ASA	80,709	162.600	13,123,283.400	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	40.200	3,744,187.800	
	TELENOR ASA	63,038	153.250	9,660,573.500	
	SCHIBSTED ASA	7,537	351.100	2,646,240.700	
	ORKLA ASA	65,283	85.960	5,611,726.680	
	EQUINOR ASA	83,149	150.000	12,472,350.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	357.500	5,431,497.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	184.900	3,084,686.700	

	ADEVINTA ASA	22,265	128.600	2,863,279.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	306.600	2,282,637.000	
ノルウェー・クローネ 小計		489,624		67,218,219.280 (797,880,263)	
ユーロ	CRH PLC	66,036	32.940	2,175,225.840	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,105	162.750	2,132,838.750	
	KERRY GROUP PLC-A	13,475	122.700	1,653,382.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	72.200	971,234.400	
	UMICORE	17,654	36.580	645,783.320	
	AIR LIQUIDE	40,275	136.000	5,477,400.000	
	AIRBUS SE	49,650	93.720	4,653,198.000	
	AXA SA	162,082	20.005	3,242,450.410	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,117	19.625	865,796.120	
	ADIDAS AG	15,912	287.600	4,576,291.200	
	ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	14.355	1,400,602.990	
	DASSAULT AVIATION SA	295	900.000	265,500.000	
	DANONE	51,855	52.380	2,716,164.900	
	SAFRAN SA	26,914	118.450	3,187,963.300	
	INTESA SANPAOLO	1,394,419	1.960	2,733,061.240	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,642	71.360	2,043,893.120	
	ACCOR SA	17,380	30.550	530,959.000	
	BOUYGUES	17,572	34.170	600,435.240	
	BNP PARIBAS	96,130	43.460	4,177,809.800	
	THALES SA	8,549	77.100	659,127.900	
	CAPGEMINI SA	13,568	116.850	1,585,420.800	
	UNICREDIT SPA	173,574	7.900	1,371,234.600	
	NATIXIS	70,166	2.639	185,168.070	
	KONINKLIJKE DSM NV	14,438	134.650	1,944,076.700	
	COMMERZBANK AG	83,118	5.196	431,881.120	
	EIFFAGE	6,494	81.200	527,312.800	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	34,713	37.950	1,317,358.350	
	UNITED INTERNET	9,882	33.580	331,837.560	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	46.080	255,559.680	
	PUBLICIS GROUPE	18,595	40.060	744,915.700	
	FAURECIA	6,117	40.500	247,738.500	
	IBERDROLA SA	510,828	11.300	5,772,356.400	
	ENI SPA	219,331	8.936	1,959,941.810	
	JERONIMO MARTINS	19,517	14.615	285,240.950	
KESKO OYJ-B	24,085	20.660	497,596.100		
KBC GROUPE	21,038	60.440	1,271,536.720		
HANNOVER RUECK SE	4,868	135.600	660,100.800		
WARTSILA OYJ	34,935	8.346	291,567.510		
L'OREAL	21,014	301.700	6,339,923.800		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,497	501.000	11,771,997.000		
GEA GROUP AG	11,838	28.180	333,594.840		
BOLLORE	71,347	3.334	237,870.890		

MEDIOBANCA SPA	57,442	7.508	431,274.530
MICHELIN(CGDE)-B	14,802	105.550	1,562,351.100
CONTINENTAL AG	8,803	112.000	985,936.000
DEUTSCHE POST AG-REG	83,086	39.090	3,247,831.740
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	28.630	607,127.780
OMV AG	12,817	32.920	421,935.640
VERBUND AG	4,908	60.000	294,480.000
PERNOD-RICARD	17,811	158.800	2,828,386.800
PEUGEOT SA	47,343	21.110	999,410.730
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,649	55.040	696,200.960
RENAULT SA	14,917	36.355	542,307.530
REPSOL SA	124,165	8.950	1,111,276.750
REMY COINTREAU	1,860	146.600	272,676.000
MERCK KGAA	10,841	134.800	1,461,366.800
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,560	39.070	1,740,959.200
RWE AG	53,941	33.600	1,812,417.600
SEB SA	1,551	143.300	222,258.300
SOCIETE GENERALE-A	69,595	17.098	1,189,935.310
VINCI S.A.	43,513	85.760	3,731,674.880
SODEXO	7,075	73.080	517,041.000
SOFINA	1,382	266.000	367,612.000
SOLVAY SA	5,563	98.160	546,064.080
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,834	114.700	5,257,159.800
VIVENDI SA	70,995	25.400	1,803,273.000
SAP SE	87,580	101.180	8,861,344.400
TELEFONICA S.A	403,880	3.861	1,559,380.680
TOTAL SE	213,239	37.665	8,031,646.930
VALEO	19,653	31.440	617,890.320
E.ON SE	188,262	9.134	1,719,585.100
VOEST-ALPINE AG	9,875	28.090	277,388.750
HENKEL AG & CO KGAA	8,602	79.650	685,149.300
SIEMENS AG-REG	65,228	113.520	7,404,682.560
UPM-KYMMENE OYJ	44,829	28.980	1,299,144.420
ING GROEP NV-CVA	329,234	8.088	2,662,844.590
PUMA AG	7,534	86.480	651,540.320
BAYER AG	84,197	47.420	3,992,621.740
STORA ENSO OYJ-R SHS	53,250	14.600	777,450.000
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,859	89.860	1,335,229.740
DAIMLER AG	72,434	56.320	4,079,482.880
BASF SE	76,828	64.040	4,920,065.120
BEIERSDORF AG	8,371	91.140	762,932.940
HOCHTIEF AG	1,707	77.300	131,951.100
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	59.060	710,550.860
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,842	68.320	1,218,965.440

ORANGE	169,379	10.325	1,748,838.170	
SAMPO OYJ-A SHS	40,512	35.170	1,424,807.040	
RANDSTAD NV	9,362	51.980	486,636.760	
ALLIANZ SE	35,019	197.120	6,902,945.280	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,662	4.765	1,137,224.430	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	92,201	23.480	2,164,879.480	
HERMES INTL	2,667	828.000	2,208,276.000	
ENDESA S.A.	27,736	22.770	631,548.720	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	9.738	272,566.620	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	25.050	606,310.200	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,715	239.300	2,803,399.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	17.446	1,074,568.920	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,280	153.500	1,731,480.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,395	26.530	567,609.350	
HEINEKEN NV	22,683	91.840	2,083,206.720	
AKZO NOBEL	16,208	87.060	1,411,068.480	
ASML HOLDING NV	35,905	376.950	13,534,389.750	
AEGON NV	150,349	3.099	465,931.550	
VOLKSWAGEN AG	2,758	157.800	435,212.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,599	144.400	2,252,495.600	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	578,251	4.054	2,344,229.550	
KERING	6,306	573.300	3,615,229.800	
CNP ASSURANCES	13,987	13.180	184,348.660	
FORTUM OYJ	39,409	18.630	734,189.670	
AGEAS	14,365	41.780	600,169.700	
UCB SA	10,571	89.020	941,030.420	
NEMETSCHEK SE	5,095	57.500	292,962.500	
CARREFOUR SA	49,926	13.900	693,971.400	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	18.910	446,502.920	
ATOS SE	8,972	73.800	662,133.600	
NOKIA OYJ	476,230	3.440	1,638,231.200	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	76,388	43.320	3,309,128.160	
WOLTERS KLUWER-CVA	23,137	68.740	1,590,437.380	
SANOFI	96,107	81.790	7,860,591.530	
STMICROELECTRONICS NV	54,176	29.460	1,596,024.960	
ELISA OYJ	10,787	44.740	482,610.380	
BANCO SANTANDER SA	1,486,679	2.648	3,936,725.990	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	16.775	580,347.900	
QIAGEN N.V.	17,974	42.290	760,120.460	
DEUTSCHE BANK AG-REG	165,949	9.107	1,511,297.540	
BMW VORZUG	4,116	54.000	222,264.000	
ENEL SPA	675,152	8.210	5,542,997.920	
COLRUYT NV	4,673	49.440	231,033.120	
VOPAK (KON.)	5,364	43.770	234,782.280	

DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	285,762	14.990	4,283,572.380	
SARTORIUS AG	3,044	361.600	1,100,710.400	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	78.340	602,121.240	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	111,890	29.045	3,249,845.050	
RATIONAL AG	479	720.500	345,119.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	109.800	414,055.800	
BECHTLE AG	2,511	174.200	437,416.200	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.478	721,169.860	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,330	65.290	739,735.700	
TELEPERFORMANCE	4,699	270.700	1,272,019.300	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,851	137.000	2,171,587.000	
EURAZEO	2,748	54.700	150,315.600	
GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	82.060	812,722.240	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	80.050	800,820.200	
INDITEX	92,847	26.720	2,480,871.840	
ESSILORLUXOTTICA	23,967	128.500	3,079,759.500	
SNAM SPA	171,294	4.567	782,299.690	
CREDIT AGRICOLE SA	98,685	10.365	1,022,870.020	
ORPEA	4,932	105.950	522,545.400	
ENAGAS	23,477	20.330	477,287.410	
WENDEL	2,220	98.250	218,115.000	
TENARIS SA	36,959	6.922	255,830.190	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.398	303,544.650	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.429	213,468.680	
ATLANTIA SPA	37,690	15.240	574,395.600	
ILIAD SA	1,046	174.500	182,527.000	
PROXIMUS	13,739	17.910	246,065.490	
SES FDR	28,847	7.884	227,429.740	
TERNA SPA	113,654	6.108	694,198.630	
BIOMERIEUX	3,248	117.900	382,939.200	
GRIFOLS SA	23,518	24.410	574,074.380	
FERROVIAL SA	40,593	23.100	937,698.300	
LANXESS AG	6,856	61.760	423,426.560	
NESTE OYJ	36,796	58.200	2,141,527.200	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	16.430	158,401.630	
RECORDATI SPA	10,303	43.970	453,022.910	
GALAPAGOS NV	3,426	97.620	334,446.120	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	9.460	523,175.840	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	209.500	873,196.000	
KONE OYJ	28,383	67.540	1,916,987.820	
ELIA GROUP	2,862	94.500	270,459.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,387	294.600	703,210.200	
ENGIE	154,115	12.395	1,910,255.420	
ALSTOM	21,779	45.680	994,864.720	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	12.500	684,725.000	
IPSEN SA	3,646	69.300	252,667.800	

DEUTSCHE WOHNEN	29,097	42.510	1,236,913.470	
ARKEMA SA	6,393	95.300	609,252.900	
LEGRAND SA	21,521	71.100	1,530,143.100	
AMPLIFON SPA	11,372	32.550	370,158.600	
ADP	2,313	105.000	242,865.000	
ORION OYJ	8,051	38.560	310,446.560	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	9.310	373,219.280	
SYMRISE AG	11,308	106.150	1,200,344.200	
SCOR SE	15,667	27.400	429,275.800	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,870	37.600	784,712.000	
PRYSMIAN SPA	22,328	27.060	604,195.680	
DIASORIN SPA	2,223	169.700	377,243.100	
CAIXABANK	307,331	2.238	687,806.770	
BUREAU VERITAS SA	23,179	22.710	526,395.090	
GETLINK	37,646	13.520	508,973.920	
SUEZ SA	26,620	15.820	421,128.400	
AMADEUS IT GROUP SA	38,173	61.200	2,336,187.600	
BRENTAG AG	12,353	62.820	776,015.460	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	26.350	451,006.600	
EDENRED	21,488	46.070	989,952.160	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.328	229,040.280	
LEG IMMOBILIEN AG	5,934	120.060	712,436.040	
KION GROUP AG	5,903	68.440	404,001.320	
VONOVIA SE	43,096	56.880	2,451,300.480	
KNORR-BREMSE AG	6,860	105.760	725,513.600	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,468	41.140	883,193.520	
FERRARI NV	10,596	176.200	1,867,015.200	
CNH INDUSTRIAL NV	89,378	8.994	803,865.730	
AROUNDTOWN SA	83,054	6.156	511,280.420	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	35.770	289,450.840	
MONCLER SPA	17,567	46.460	816,162.820	
NEXI SPA	33,176	16.030	531,811.280	
TEAMVIEWER AG	11,117	38.520	428,226.840	
PROSUS NV	40,543	92.240	3,739,686.320	
JDE PEET'S BV	7,308	33.200	242,625.600	
SIEMENS ENERGY AG	31,959	25.500	814,954.500	
WORLDLINE SA	20,129	73.820	1,485,922.780	
NN GROUP NV	25,274	33.990	859,063.260	
FINECOBANK SPA	53,818	13.230	712,012.140	
ARGENX SE	3,879	233.600	906,134.400	
ZALANDO SE	13,039	78.880	1,028,516.320	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	94,487	13.830	1,306,755.210	
AENA SME SA	5,338	136.100	726,501.800	
CELLNEX TELECOM SAU	27,234	51.360	1,398,738.240	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,836	86.160	933,629.760	

	ABN AMRO BANK NV	34,251	8.232	281,954.230	
	EXOR NV	7,971	60.200	479,854.200	
	ALTICE EUROPE NV	56,763	4.450	252,595.350	
	SCOUT24 AG	9,670	66.350	641,604.500	
	COVESTRO AG	16,337	49.850	814,399.450	
	HELLOFRESH SE	12,838	57.650	740,110.700	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,579	58.380	3,711,742.020	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	8.418	336,846.270	
	AMUNDI SA	4,119	67.600	278,444.400	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	9.805	228,887.920	
	ADYEN NV	1,516	1,752.000	2,656,032.000	
	UNIPER SE	18,203	27.880	507,499.640	
	DELIVERY HERO SE	10,974	108.300	1,188,484.200	
ユーロ	小計	15,844,052		344,988,936.140 (43,568,652,745)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	97.450	3,206,105.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	19.620	3,217,680.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	16.940	1,759,388.400	
	CLP HOLDINGS LTD	134,500	71.150	9,569,675.000	
	PCCW LTD	331,000	4.740	1,568,940.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	40.000	1,980,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	102,640	384.200	39,434,288.000	
	MTR CORP	126,000	42.650	5,373,900.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	136.800	8,987,760.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	31.150	3,596,267.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	134,500	41.350	5,561,575.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	913,292	11.780	10,758,579.760	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	177,000	60.950	10,788,150.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	24.450	7,762,875.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	121,066	37.650	4,558,134.900	
	SINO LAND CO	255,400	10.340	2,640,836.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,500	104.600	11,349,100.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	44.500	2,202,750.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	116,500	103.000	11,999,500.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	18.680	3,100,880.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.320	1,453,920.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	13.640	1,696,816.000	
	AIA GROUP LTD	1,016,027	89.550	90,985,217.850	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	10.360	2,994,040.000	
	SANDS CHINA LTD	198,800	34.500	6,858,600.000	

SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.550	2,453,910.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	39.500	5,915,125.000	
ESR CAYMAN LTD	147,400	24.000	3,537,600.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.760	1,784,800.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	26.450	3,983,370.000	
WH GROUP LTD	731,500	6.490	4,747,435.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	228,332	55.850	12,752,342.200	
CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	43.050	9,679,017.600	
香港・ドル 小計	7,335,649		298,258,578.210 (4,002,630,120)	
合計	92,051,508		397,415,515,754 (397,415,515,754)	

(2) 株式以外の有価証券

2020年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	スイス・フラン	CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23	87,844.000	15,811.920	
	スイス・フラン	小計	87,844.000	15,811.920 (1,856,477)	
新株予約権証券 合計			87,844	1,856,477 (1,856,477)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	84,575.000	818,686.000	
		GOODMAN GROUP	134,222.000	2,436,129.300	
		GPT GROUP	158,232.000	743,690.400	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	889,428.600	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,185,155.760	
		STOCKLAND	194,018.000	851,739.020	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	465,161.960	
	オーストラリア・ドル	小計	1,591,176.000	7,389,991.040 (578,636,299)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	842,705.280	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	347,536.000	726,350.240	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	398,061.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	513,190.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	286,229.000	
シンガポール・ドル	小計	1,294,642.000	2,766,535.520 (215,651,444)		
投資信託受益証券 合計			2,885,818	794,287,743	

				(794,287,743)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	713,434.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,713.000	1,832,030.130	
		AMERICAN TOWER CORP	37,134.000	8,147,570.940	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559.000	1,048,534.980	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,329.000	2,003,709.080	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,947.000	1,319,299.300	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,601.000	728,859.890	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	36,589.000	5,752,522.580	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,230.000	2,882,341.800	
		DUKE REALTY TRUST	31,929.000	1,220,964.960	
		EQUINIX INC	7,385.000	5,073,421.150	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	810,201.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	32,078.000	1,917,943.620	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,504.000	1,350,736.640	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,566.000	1,162,471.320	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,543.000	1,345,340.220	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	817,370.280	
		INVITATION HOMES INC	46,060.000	1,331,594.600	
		IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	744,861.390	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	40,988.000	839,844.120	
		MID AMERICA	9,014.000	1,083,302.520	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17,771.000	663,213.720	
		PROLOGIS INC	61,657.000	5,991,827.260	
		PUBLIC STORAGE	13,090.000	2,835,032.200	
		REALTY INCOME CORP	29,466.000	1,765,897.380	
		REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	690,297.390	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,281.000	2,557,843.600	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	28,083.000	2,539,826.520	
		SUN COMMUNITIES INC	8,298.000	1,164,126.420	
		UDR INC	27,057.000	1,037,094.810	
		VENTAS INC	31,091.000	1,518,173.530	
		VEREIT INC	102,670.000	775,158.500	
		VICI PROPERTIES INC	47,083.000	1,197,320.690	
VORNADO REALTY TRUST	12,714.000	504,872.940			
WELLTOWER INC	35,270.000	2,258,338.100			
WEYERHAEUSER CO	64,096.000	2,035,048.000			
WP CAREY INC	15,529.000	1,065,134.110			
アメリカ・ドル	小計	1,153,185.000	70,725,560.650	(7,356,165,563)	

イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	343,858.570	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	396,485.300	
	SEGRO PLC	100,956.000	913,046.060	
イギリス・ポンド 小計		226,618.000	1,653,389.930 (228,630,760)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,954.000	396,268.280	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	232,979.100	
カナダ・ドル 小計		21,421.000	629,247.380 (51,334,001)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	348,326.100	
	GECINA SA	3,670.000	466,824.000	
	KLEPIERRE	17,099.000	322,914.610	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	791,996.000	
ユーロ 小計		38,352.000	1,930,060.710 (243,747,367)	
香港・ドル	LINK REIT	176,700.000	12,280,650.000	
香港・ドル 小計		176,700.000	12,280,650.000 (164,806,323)	
投資証券 合計		1,616,276	8,044,684,014 (8,044,684,014)	
合計			8,840,828,234 (8,840,828,234)	

(注) 新株予約権証券、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 (%)	組入新株 予約権証 券 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 594銘柄	68.76	-	-	-	71.65
	投資証券 37銘柄	-	-	-	1.78	
イギリス・ポンド	株式 85銘柄	4.65	-	-	-	4.78
	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 58銘柄	2.21	-	-	-	2.39
	投資信託受益証 券 7銘柄	-	-	0.14	-	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.42	-	-	-	3.48
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.30	-	-	-	0.35

	投資信託受益証券	5銘柄	-	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式	39銘柄	3.15	-	-	-	3.20
	新株予約権証券	1銘柄	-	0.00	-	-	
スウェーデン・クローナ	株式	38銘柄	1.11	-	-	-	1.13
デンマーク・クローネ	株式	19銘柄	0.79	-	-	-	0.81
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.10	-	-	-	0.10
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.19	-	-	-	0.20
ユーロ	株式	234銘柄	10.56	-	-	-	10.78
	投資証券	4銘柄	-	-	-	0.06	
香港・ドル	株式	33銘柄	0.97	-	-	-	1.03
	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2020年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,789,893,332
コール・ローン	2,006,727,497
国債証券	517,312,366,830
派生商品評価勘定	721,224,894
未収利息	1,900,126,349
前払費用	770,024,457
流動資産合計	526,500,363,359
資産合計	
526,500,363,359	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,006,400,975
未払金	111,014,204
未払解約金	17,369,000
流動負債合計	3,134,784,179
負債合計	
3,134,784,179	
純資産の部	
元本等	
元本	352,957,920,687
剰余金	
剰余金又は欠損金()	170,407,658,493
元本等合計	523,365,579,180
純資産合計	
523,365,579,180	
負債純資産合計	
526,500,363,359	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基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	2020年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	228,630,884,001円
同期中追加設定元本額	220,870,724,711円
同期中一部解約元本額	96,543,688,025円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	6,098,581,406円
たわらノーロード バランス(堅実型)	342,259,702円
たわらノーロード バランス(標準型)	818,824,993円
たわらノーロード バランス(積極型)	367,933,100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)	20,780,552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)	675,051,305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)	669,636,142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)	188,154,424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)	42,669,633円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	4,164,002円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,410,448円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	15,783,354円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,092,305円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,294,365円
投資のソムリエ	130,076,905,840円
投資のソムリエ<DC年金>	8,958,405,363円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	8,590,135,040円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	90,373,939,334円
ワールドアセットバランス(基本コース)	3,050,723,552円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	6,562,474,078円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	86,936,582円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	40,864,615円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	81,786,881円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	258,210,128円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	55,180,101,033円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,836,579,195円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	41,993,652円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	21,558,301円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	22,118,792円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,958,081,268円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	6,281,271,845円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	634,219,570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)	49,749,333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)	393,481,339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)	783,347,501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)	1,130,753,416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)	2,096,645,135円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,183,735,880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)	2,887,293,805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)	115,973,478円
計	352,957,920,687円
2. 受益権の総数	352,957,920,687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 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2020年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2020年12月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	598,601,672	
合計	598,601,672	

(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(2020年6月23日から2020年12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	520,516,792,526	-	522,801,968,607	2,285,176,081
イギリス・ポンド	226,035,933,283	-	225,638,408,850	397,524,433
イスラエル・シケル	34,539,106,915	-	34,282,400,256	256,706,659
オーストラリア・ドル	2,290,983,714	-	2,320,035,362	29,051,648
カナダ・ドル	14,067,785,853	-	14,329,467,120	261,681,267
シンガポール・ドル	10,327,980,156	-	10,470,946,605	142,966,449
スウェーデン・クローナ	2,281,497,928	-	2,285,027,774	3,529,846
デンマーク・クローネ	1,704,761,892	-	1,720,276,096	15,514,204
ノルウェー・クローネ	2,662,211,727	-	2,691,688,065	29,476,338
ポーランド・ズロチ	1,138,167,985	-	1,146,363,880	8,195,895
マレーシア・リンギット	3,280,833,657	-	3,358,463,745	77,630,088
	2,264,276,362	-	2,272,375,300	8,098,938

メキシコ・ペソ	4,489,158,497	-	4,510,507,274	21,348,777
ユーロ	215,434,094,557	-	217,776,008,280	2,341,913,723
合計	520,516,792,526	-	522,801,968,607	2,285,176,081

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2020年12月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4828円 (14,828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

2020年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 04/30/22	5,670,000.000	5,671,107.350	
		US T N/B 0.125 05/15/23	8,630,000.000	8,622,583.550	
		US T N/B 0.125 05/31/22	8,000,000.000	7,999,687.440	
		US T N/B 0.125 07/15/23	9,000,000.000	8,987,695.290	
		US T N/B 0.125 07/31/22	11,110,000.000	11,107,829.990	
		US T N/B 0.125 08/15/23	6,000,000.000	5,991,796.860	
		US T N/B 0.125 08/31/22	17,610,000.000	17,605,184.720	
		US T N/B 0.125 09/15/23	13,000,000.000	12,980,195.280	
		US T N/B 0.125 09/30/22	18,620,000.000	18,614,908.540	
		US T N/B 0.125 10/15/23	16,370,000.000	16,343,782.290	
		US T N/B 0.125 10/31/22	16,730,000.000	16,724,118.230	
		US T N/B 0.125 11/30/22	17,350,000.000	17,346,611.190	
		US T N/B 0.25 04/15/23	8,130,000.000	8,148,101.440	
		US T N/B 0.25 05/31/25	8,500,000.000	8,470,781.250	
		US T N/B 0.25 06/15/23	11,000,000.000	11,020,195.230	
		US T N/B 0.25 06/30/25	12,230,000.000	12,179,360.090	

US T N/B 0.25 07/31/25	13,440,000.000	13,378,049.930	
US T N/B 0.25 08/31/25	10,000,000.000	9,949,218.700	
US T N/B 0.25 09/30/25	10,750,000.000	10,689,531.250	
US T N/B 0.25 10/31/25	16,000,000.000	15,902,500.000	
US T N/B 0.25 11/15/23	16,730,000.000	16,762,022.220	
US T N/B 0.375 03/31/22	14,270,000.000	14,319,053.120	
US T N/B 0.375 04/30/25	8,230,000.000	8,248,324.090	
US T N/B 0.375 07/31/27	10,850,000.000	10,694,031.250	
US T N/B 0.375 09/30/27	10,000,000.000	9,832,812.500	
US T N/B 0.375 11/30/25	15,040,000.000	15,034,124.920	
US T N/B 0.5 03/15/23	7,000,000.000	7,054,413.800	
US T N/B 0.5 03/31/25	10,800,000.000	10,883,952.720	
US T N/B 0.5 04/30/27	7,500,000.000	7,470,410.170	
US T N/B 0.5 05/31/27	7,960,000.000	7,920,821.830	
US T N/B 0.5 06/30/27	11,130,000.000	11,067,393.750	
US T N/B 0.5 08/31/27	9,000,000.000	8,931,796.830	
US T N/B 0.5 10/31/27	15,000,000.000	14,860,546.800	
US T N/B 0.625 03/31/27	6,720,000.000	6,749,662.080	
US T N/B 0.625 05/15/30	18,860,000.000	18,435,650.000	
US T N/B 0.625 08/15/30	25,970,000.000	25,320,750.000	
US T N/B 0.875 11/15/30	10,820,000.000	10,786,187.500	
US T N/B 1.125 02/28/22	10,000,000.000	10,124,218.000	
US T N/B 1.125 02/28/25	7,790,000.000	8,057,781.250	
US T N/B 1.125 02/28/27	4,000,000.000	4,142,968.400	
US T N/B 1.125 05/15/40	12,070,000.000	11,483,473.430	
US T N/B 1.125 08/15/40	18,670,000.000	17,718,996.870	
US T N/B 1.25 05/15/50	16,750,000.000	15,217,636.630	
US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,639,531.200	
US T N/B 1.25 08/31/24	8,000,000.000	8,295,000.000	
US T N/B 1.375 01/31/25	9,960,000.000	10,401,196.820	
US T N/B 1.375 02/15/23	9,870,000.000	10,129,473.020	
US T N/B 1.375 06/30/23	5,390,000.000	5,555,489.810	
US T N/B 1.375 08/15/50	17,000,000.000	15,941,484.280	
US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	9,812,460.890	
US T N/B 1.375 08/31/26	6,000,000.000	6,305,156.220	
US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	9,303,750.000	
US T N/B 1.375 10/15/22	5,500,000.000	5,625,253.860	
US T N/B 1.5 01/15/23	8,000,000.000	8,224,687.440	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,790,000.000	6,129,257.810	
US T N/B 1.5 02/15/30	14,550,000.000	15,390,035.070	
US T N/B 1.5 02/28/23	7,620,000.000	7,845,623.390	
US T N/B 1.5 03/31/23	9,390,000.000	9,676,101.550	
US T N/B 1.5 08/15/22	11,300,000.000	11,560,871.000	
US T N/B 1.5 08/15/26	10,510,000.000	11,112,682.800	
US T N/B 1.5 09/15/22	8,410,000.000	8,610,722.980	
US T N/B 1.5 09/30/24	8,000,000.000	8,375,624.960	
US T N/B 1.5 10/31/24	8,000,000.000	8,381,250.000	
US T N/B 1.5 11/30/24	10,920,000.000	11,446,378.060	
US T N/B 1.625 02/15/26	10,850,000.000	11,524,734.370	

US T N/B 1.625 04/30/23	8,000,000.000	8,278,750.000	
US T N/B 1.625 05/15/26	15,020,000.000	15,970,484.360	
US T N/B 1.625 05/31/23	5,460,000.000	5,656,645.280	
US T N/B 1.625 08/15/22	8,000,000.000	8,200,937.440	
US T N/B 1.625 08/15/29	9,900,000.000	10,585,265.620	
US T N/B 1.625 08/31/22	10,660,000.000	10,931,496.870	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	4,070,389.040	
US T N/B 1.625 10/31/23	5,780,000.000	6,022,037.500	
US T N/B 1.625 10/31/26	5,100,000.000	5,434,687.500	
US T N/B 1.625 11/15/22	17,200,000.000	17,691,140.490	
US T N/B 1.625 11/15/50	8,400,000.000	8,378,343.700	
US T N/B 1.625 11/30/26	5,310,000.000	5,657,224.190	
US T N/B 1.625 12/15/22	8,600,000.000	8,855,648.410	
US T N/B 1.625 12/31/21	3,070,000.000	3,119,255.380	
US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,457,353.120	
US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,710,000.000	
US T N/B 1.75 03/31/22	5,290,000.000	5,403,239.060	
US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,279,052.720	
US T N/B 1.75 05/15/23	10,000,000.000	10,382,812.500	
US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,716,128.850	
US T N/B 1.75 06/15/22	3,700,000.000	3,790,042.940	
US T N/B 1.75 06/30/22	5,160,000.000	5,289,806.250	
US T N/B 1.75 06/30/24	7,510,000.000	7,913,075.740	
US T N/B 1.75 07/15/22	2,940,000.000	3,015,911.710	
US T N/B 1.75 07/31/24	8,000,000.000	8,437,500.000	
US T N/B 1.75 09/30/22	10,390,000.000	10,693,582.810	
US T N/B 1.75 11/15/29	9,240,000.000	9,984,975.000	
US T N/B 1.75 12/31/24	9,000,000.000	9,530,859.320	
US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	5,356,063.250	
US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	6,976,800.000	
US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,492,421.860	
US T N/B 1.875 04/30/22	10,390,000.000	10,643,256.250	
US T N/B 1.875 06/30/26	4,000,000.000	4,313,437.480	
US T N/B 1.875 07/31/22	10,290,000.000	10,583,425.720	
US T N/B 1.875 07/31/26	5,000,000.000	5,394,531.250	
US T N/B 1.875 08/31/22	8,000,000.000	8,238,750.000	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,320,000.000	7,760,343.750	
US T N/B 1.875 09/30/22	8,860,000.000	9,136,875.000	
US T N/B 1.875 10/31/22	4,000,000.000	4,130,937.480	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	10,225,390.600	
US T N/B 2.0 02/15/23	8,020,000.000	8,339,546.870	
US T N/B 2.0 02/15/25	11,340,000.000	12,143,545.250	
US T N/B 2.0 02/15/50	11,160,000.000	12,142,603.050	
US T N/B 2.0 04/30/24	4,560,000.000	4,836,450.000	
US T N/B 2.0 05/31/24	12,440,000.000	13,203,893.740	
US T N/B 2.0 06/30/24	7,540,000.000	8,010,660.890	
US T N/B 2.0 08/15/25	13,590,000.000	14,634,731.250	
US T N/B 2.0 10/31/22	2,720,000.000	2,815,200.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	13,900,000.000	15,118,421.870	

US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,458,542.120	
US T N/B 2.125 02/29/24	6,950,000.000	7,378,945.300	
US T N/B 2.125 03/31/24	11,900,000.000	12,652,117.120	
US T N/B 2.125 05/15/22	4,150,000.000	4,268,177.720	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,190,000.000	10,999,627.290	
US T N/B 2.125 05/31/26	6,070,000.000	6,623,887.500	
US T N/B 2.125 06/30/22	3,820,000.000	3,938,479.660	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,810,000.000	7,275,527.300	
US T N/B 2.125 09/30/24	6,650,000.000	7,119,656.250	
US T N/B 2.125 11/30/23	8,000,000.000	8,461,250.000	
US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	4,259,375.760	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	7,148,750.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	14,046,328.120	
US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	4,024,223.410	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,660,000.000	9,563,210.890	
US T N/B 2.25 03/31/26	7,530,000.000	8,248,879.680	
US T N/B 2.25 04/15/22	8,560,000.000	8,805,096.850	
US T N/B 2.25 04/30/24	8,000,000.000	8,551,250.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	15,850,000.000	17,560,066.310	
US T N/B 2.25 08/15/46	9,080,000.000	10,387,378.060	
US T N/B 2.25 08/15/49	10,830,000.000	12,424,886.640	
US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,910,193.720	
US T N/B 2.25 11/15/24	15,840,000.000	17,057,700.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	13,320,000.000	14,537,531.240	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,060,000.000	13,380,946.870	
US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	8,502,500.000	
US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,890,276.560	
US T N/B 2.375 01/31/23	10,760,000.000	11,266,896.820	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	6,204,187.500	
US T N/B 2.375 03/15/22	3,000,000.000	3,084,960.930	
US T N/B 2.375 04/30/26	6,620,000.000	7,306,825.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	11,540,000.000	12,863,493.740	
US T N/B 2.375 05/15/29	10,760,000.000	12,157,118.740	
US T N/B 2.375 08/15/24	13,790,000.000	14,870,575.700	
US T N/B 2.375 11/15/49	9,480,000.000	11,164,921.820	
US T N/B 2.5 01/15/22	6,320,000.000	6,485,159.350	
US T N/B 2.5 01/31/24	8,490,000.000	9,103,535.110	
US T N/B 2.5 01/31/25	5,160,000.000	5,629,237.500	
US T N/B 2.5 02/15/22	7,160,000.000	7,361,654.660	
US T N/B 2.5 02/15/45	7,690,000.000	9,187,747.610	
US T N/B 2.5 02/15/46	6,550,000.000	7,841,066.350	
US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	6,113,400.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	7,079,624.960	
US T N/B 2.5 05/15/24	15,670,000.000	16,897,891.320	
US T N/B 2.5 05/15/46	6,590,000.000	7,891,525.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	10,000,000.000	10,625,781.200	
US T N/B 2.625 01/31/26	7,260,000.000	8,082,989.010	
US T N/B 2.625 02/15/29	14,760,000.000	16,939,406.240	
US T N/B 2.625 02/28/23	5,370,000.000	5,662,413.250	

US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,867,808.570	
US T N/B 2.625 06/30/23	8,780,000.000	9,328,750.000	
US T N/B 2.625 12/31/23	9,670,000.000	10,386,939.790	
US T N/B 2.625 12/31/25	7,300,000.000	8,117,257.770	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	12,901,176.550	
US T N/B 2.75 02/15/28	17,590,000.000	20,168,034.370	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,937,181.990	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	11,325,204.680	
US T N/B 2.75 05/31/23	10,880,000.000	11,570,200.000	
US T N/B 2.75 06/30/25	3,100,000.000	3,437,851.540	
US T N/B 2.75 07/31/23	4,000,000.000	4,271,250.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	4,000,000.000	4,972,187.470	
US T N/B 2.75 08/15/47	7,980,000.000	10,031,732.770	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,519,903.120	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,230,000.000	1,368,278.900	
US T N/B 2.75 11/15/23	13,330,000.000	14,330,791.330	
US T N/B 2.75 11/15/42	6,920,000.000	8,593,775.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	7,810,000.000	9,821,075.000	
US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,690,464.040	
US T N/B 2.875 05/15/28	17,350,000.000	20,102,956.940	
US T N/B 2.875 05/15/43	7,510,000.000	9,518,338.230	
US T N/B 2.875 05/15/49	12,860,000.000	16,635,615.610	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	5,066,140.620	
US T N/B 2.875 07/31/25	7,720,000.000	8,615,640.580	
US T N/B 2.875 08/15/28	14,270,000.000	16,578,841.330	
US T N/B 2.875 08/15/45	6,380,000.000	8,135,496.870	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,397,580.420	
US T N/B 2.875 10/31/23	9,290,000.000	10,011,426.560	
US T N/B 2.875 11/15/46	5,750,000.000	7,362,246.060	
US T N/B 2.875 11/30/23	3,810,000.000	4,113,609.370	
US T N/B 2.875 11/30/25	6,780,000.000	7,613,728.120	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,460,000.000	8,463,104.650	
US T N/B 3.0 02/15/48	9,100,000.000	11,965,789.000	
US T N/B 3.0 02/15/49	12,860,000.000	17,010,363.980	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,710,000.000	4,785,610.120	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,980,000.000	9,071,273.390	
US T N/B 3.0 05/15/47	5,000,000.000	6,559,375.000	
US T N/B 3.0 08/15/48	10,530,000.000	13,887,260.100	
US T N/B 3.0 09/30/25	7,430,000.000	8,361,071.870	
US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	7,393,837.460	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,810,000.000	8,834,378.860	
US T N/B 3.0 11/15/45	2,210,000.000	2,880,251.560	
US T N/B 3.125 02/15/42	3,960,000.000	5,207,090.600	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,760,000.000	6,263,490.570	
US T N/B 3.125 05/15/48	11,140,000.000	14,998,965.610	
US T N/B 3.125 08/15/44	7,430,000.000	9,822,111.670	
US T N/B 3.125 11/15/28	13,770,000.000	16,308,843.750	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,770,000.000	4,944,296.050	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,110,000.000	7,005,889.810	

US T N/B 3.375 11/15/48	8,640,000.000	12,164,849.990	
US T N/B 3.5 02/15/39	3,670,000.000	5,000,088.250	
US T N/B 3.625 02/15/44	9,670,000.000	13,726,867.180	
US T N/B 3.625 08/15/43	6,050,000.000	8,568,312.500	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,590,000.000	5,117,993.750	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,190,000.000	7,490,224.190	
US T N/B 3.875 08/15/40	3,700,000.000	5,321,929.660	
US T N/B 4.25 05/15/39	3,700,000.000	5,506,640.620	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,320,000.000	5,006,196.850	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,804,317.950	
US T N/B 4.375 05/15/40	3,670,000.000	5,595,603.120	
US T N/B 4.375 05/15/41	3,150,000.000	4,847,308.570	
US T N/B 4.375 11/15/39	3,650,000.000	5,537,734.370	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,320,000.000	3,418,918.730	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,250,000.000	1,894,238.270	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,851,477.310	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	4,366,350.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,610,000.000	5,790,947.620	
US T N/B 5.0 05/15/37	2,810,000.000	4,418,285.930	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,128,021.870	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,295,664.050	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,200,000.000	3,169,031.250	
US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,265,235.920	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,029,062.480	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,818,269.510	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,210,000.000	1,807,532.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,396,078.110	
アメリカ・ドル 小計	1,978,520,000.000 (205,785,865,200)	2,145,277,847.550 (223,130,348,926)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	4,860,000.000	4,896,450.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	11,440,000.000	11,490,107.200
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	2,660,000.000	2,675,355.910
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	5,270,000.000	5,291,625.960
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	6,270,000.000	6,365,329.080
	UK TREASURY 0.5 07/22/22	5,280,000.000	5,333,399.800
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,400,000.000	2,271,201.600
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	5,790,000.000	5,975,145.660
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,810,000.000	2,843,666.040
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	5,210,000.000	5,043,398.780
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	5,400,000.000	5,523,800.400

UK TREASURY 0.875 10/22/29	3,740,000.000	3,978,320.280	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	3,750,000.000	3,890,615.980	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,860,000.000	4,175,192.160	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	3,180,000.000	3,520,471.780	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,090,000.000	3,360,824.590	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	4,290,000.000	5,074,514.870	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	3,740,000.000	4,198,347.460	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	2,800,000.000	3,559,279.350	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	2,820,000.000	4,157,735.790	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,170,000.000	2,728,080.600	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	4,060,000.000	5,466,587.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	5,000,000.000	5,162,874.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	6,350,000.000	7,516,304.500	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,530,000.000	2,779,771.720	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,830,000.000	4,078,628.650	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,280,000.000	5,631,219.440	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,766,913.490	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	6,110,000.000	9,396,996.700	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	5,320,000.000	8,575,182.430	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	3,270,000.000	7,121,275.200	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,140,000.000	5,837,084.160	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	3,380,000.000	7,266,138.770	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,720,000.000	5,761,638.650	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	4,230,000.000	6,110,397.420	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,730,000.000	4,487,366.520	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,340,000.000	4,327,533.780	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,530,000.000	5,910,713.190	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	4,870,000.000	8,918,693.980	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	3,040,000.000	5,835,185.140	

	UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,650,000.000	7,681,933.070	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,260,000.000	5,030,310.400	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	4,110,000.000	7,305,954.070	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	4,460,000.000	6,465,417.580	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,780,000.000	6,476,972.530	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	3,780,000.000	4,600,151.500	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,130,376.520	
イギリス・ボンド 小計		189,550,000.000 (26,210,974,000)	248,994,483.700 (34,430,957,206)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.15 07/31/23	3,000,000.000	2,992,455.000	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	3,000,000.000	3,022,470.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,710,000.000	2,740,620.290	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	6,000,000.000	6,125,130.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	3,140,000.000	3,111,975.500	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	3,860,000.000	4,001,723.760	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	4,020,000.000	4,276,853.880	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	6,700,000.000	7,317,592.600	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	4,770,000.000	5,333,518.260	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	4,020,000.000	4,475,449.920	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	5,180,000.000	7,057,936.480	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	6,660,000.000	7,277,681.700	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	4,110,000.000	6,892,112.430	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,300,000.000	3,072,261.800	
イスラエル・シュケル 小計		59,470,000.000 (1,900,066,500)	67,697,781.620 (2,162,944,123)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	6,110,000.000	6,121,085.370	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	6,000,000.000	5,976,574.020	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	9,050,000.000	9,075,677.560	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	6,600,000.000	6,554,797.180	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	6,000,000.000	6,007,935.000	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	3,900,000.000	3,959,830.680	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	7,050,000.000	7,382,688.790	

	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	4,000,000.000	3,766,400.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	7,110,000.000	7,916,985.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	7,410,000.000	7,720,689.430	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	8,010,000.000	9,150,573.520	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	8,580,000.000	9,340,290.960	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	3,450,000.000	4,044,155.550	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,820,000.000	2,155,159.910	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	7,870,000.000	9,016,265.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	7,090,000.000	8,189,532.080	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	7,320,000.000	8,491,932.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,770,000.000	3,399,324.880	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	6,880,000.000	7,770,827.200	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	8,220,000.000	9,851,714.370	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	2,270,000.000	2,858,280.470	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	3,020,000.000	4,018,565.710	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	4,550,000.000	5,485,605.120	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,690,000.000	5,119,628.470	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	6,540,000.000	8,272,582.030	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	10,640,000.000	11,986,719.680	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,040,000.000	4,405,041.060	
	オーストラリア・ドル 小計	159,990,000.000 (12,527,217,000)	178,038,861.540 (13,940,442,859)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	920,000.000	1,354,736.800	
	CANADA 0.25 02/01/23	4,000,000.000	3,999,680.000	
	CANADA 0.25 03/01/26	3,030,000.000	2,995,064.100	
	CANADA 0.25 04/01/24	2,300,000.000	2,294,227.000	
	CANADA 0.25 08/01/22	5,500,000.000	5,500,220.000	
	CANADA 0.25 11/01/22	5,350,000.000	5,351,177.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	4,170,000.000	4,185,762.600	
	CANADA 0.5 09/01/25	8,740,000.000	8,749,614.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	4,000,000.000	3,891,680.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,320,000.000	2,386,816.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	5,080,000.000	5,147,411.600	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,060,000.000	2,133,356.600	
	CANADA 1.25 06/01/30	9,090,000.000	9,494,232.300	
	CANADA 1.5 05/01/22	1,920,000.000	1,954,502.400	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,130,000.000	3,224,557.300	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,350,000.000	2,476,782.500	
	CANADA 1.5 09/01/24	1,810,000.000	1,886,363.900	
	CANADA 1.75 03/01/23	5,070,000.000	5,237,360.700	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,860,000.000	3,151,805.800	
	CANADA 2.0 09/01/23	5,750,000.000	6,016,627.500	
	CANADA 2.0 12/01/51	6,090,000.000	7,194,238.800	
	CANADA 2.25 03/01/24	1,050,000.000	1,114,837.500	
	CANADA 2.25 06/01/25	3,040,000.000	3,285,844.800	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,980,000.000	2,235,697.200	
	CANADA 2.5 06/01/24	3,210,000.000	3,449,016.600	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,950,000.000	3,060,035.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	2,840,000.000	3,831,898.400	

	CANADA 2.75 12/01/64	970,000.000	1,443,049.600	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,010,000.000	4,479,060.600	
	CANADA 4.0 06/01/41	3,060,000.000	4,655,728.800	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,950,000.000	3,119,434.500	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,930,000.000	2,732,744.900	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,260,000.000	3,548,471.200	
カナダ・ドル 小計		113,790,000.000 (9,282,988,200)	125,582,036.000 (10,244,982,497)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	340,000.000	339,221.400	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	1,800,000.000	1,852,971.480	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	1,030,000.000	1,216,996.500	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	580,000.000	608,987.470	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	1,180,000.000	1,273,950.180	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	1,110,000.000	1,286,484.450	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	1,470,000.000	1,591,096.390	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	830,000.000	991,430.850	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,020,000.000	1,149,854.860	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,480,000.000	1,944,781.690	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,300,000.000	1,655,357.460	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	2,180,000.000	2,310,850.790	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,930,000.000	2,242,488.990	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,420,000.000	1,675,770.400	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,970,000.000	2,156,138.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,220,000.000	2,326,093.800	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,520,000.000	1,930,033.050		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,630,000.000	1,902,589.460		
シンガポール・ドル 小計		25,010,000.000 (1,949,529,500)	28,455,097.220 (2,218,074,828)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	7,390,000.000	7,503,449.060	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	11,710,000.000	12,543,232.050	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	13,910,000.000	15,000,961.300	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	16,970,000.000	18,269,806.950	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	19,860,000.000	20,973,351.600	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	17,950,000.000	20,244,728.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	11,720,000.000	18,404,150.400	
SWEDEN 3.5 06/01/22	15,310,000.000	16,191,687.590		
スウェーデン・クローナ 小計		114,820,000.000 (1,414,582,400)	129,131,366.950 (1,590,898,441)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	12,700,000.000	12,901,930.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	6,900,000.000	7,490,640.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	17,090,000.000	18,378,432.190	
	DENMARK 0.5 11/15/29	27,880,000.000	30,424,886.400	
	DENMARK 1.5 11/15/23	13,600,000.000	14,468,822.400	
	DENMARK 1.75 11/15/25	14,670,000.000	16,419,221.460	
	DENMARK 4.5 11/15/39	28,490,000.000	54,687,489.410	
デンマーク・クローネ 小計		121,330,000.000	154,771,421.860	

		(2,058,970,100)	(2,626,471,029)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.375 08/19/30	9,410,000.000	9,823,710.650	
	NORWAY 1.5 02/19/26	8,270,000.000	8,657,466.040	
	NORWAY 1.75 02/17/27	10,110,000.000	10,765,507.120	
	NORWAY 1.75 03/13/25	7,570,000.000	7,969,809.550	
	NORWAY 1.75 09/06/29	12,730,000.000	13,693,088.150	
	NORWAY 2.0 04/26/28	9,010,000.000	9,817,746.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	18,110,000.000	18,868,816.240	
	NORWAY 3.0 03/14/24	12,080,000.000	13,105,350.400	
ノルウェー・クローネ 小計		87,290,000.000 (1,036,132,300)	92,701,494.650 (1,100,366,741)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.75 04/25/25	3,140,000.000	3,180,078.640	
	POLAND 07/25/22	4,910,000.000	4,908,454.320	
	POLAND 1.25 10/25/30	9,600,000.000	9,502,761.120	
	POLAND 2.25 04/25/22	8,340,000.000	8,600,208.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	6,880,000.000	7,399,644.320	
	POLAND 2.5 01/25/23	8,340,000.000	8,778,376.240	
	POLAND 2.5 04/25/24	7,640,000.000	8,236,252.330	
	POLAND 2.5 07/25/26	10,320,000.000	11,332,708.820	
	POLAND 2.5 07/25/27	7,800,000.000	8,585,820.340	
	POLAND 2.75 04/25/28	9,190,000.000	10,290,502.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	4,912,412.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	10,150,000.000	11,424,332.500	
	POLAND 4.0 10/25/23	7,010,000.000	7,798,554.900	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,485,350.000	
POLAND 5.75 09/23/22	4,750,000.000	5,236,039.000		
ポーランド・ズロチ 小計		104,230,000.000 (2,973,681,900)	112,671,495.030 (3,214,517,753)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	5,134,250.000	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	2,000,000.000	2,095,374.400	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	4,045,067.410	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,845,511.760	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	4,000,000.000	4,305,265.600	
	MALAYSIA 3.757 04/20/23	2,000,000.000	2,083,481.000	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	2,000,000.000	2,066,313.800	
	MALAYSIA 3.795 09/30/22	2,600,000.000	2,691,109.460	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	2,900,000.000	3,039,196.520	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	4,150,000.000	4,404,383.790	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	3,840,000.000	4,084,684.030	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	2,000,000.000	2,143,247.000	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	5,270,000.000	5,711,578.570	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,489,622.370	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	2,000,000.000	2,168,871.800	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,626,011.850	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	2,000,000.000	2,164,193.800		
MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,400,000.000	4,749,092.480		

	MALAYSIA 4.059 09/30/24	2,960,000.000	3,172,197.960	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	2,500,000.000	2,515,004.500	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,348,995.970	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	2,232,831.600	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	2,200,000.000	2,442,505.560	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	2,830,000.000	3,127,228.380	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	3,201,730.140	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,540,000.000	2,895,629.460	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	2,300,000.000	2,571,314.900	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,500,000.000	4,030,898.900	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	2,000,000.000	2,330,524.000	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,900,000.000	2,179,772.530	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	4,014,615.790	
マレーシア・リングット 小計		88,730,000.000 (2,276,811,800)	95,910,505.330 (2,461,063,567)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	66,690,000.000	70,039,838.700	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	18,613,000.000	25,745,687.730	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	58,913,000.000	70,313,843.760	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	43,964,000.000	45,653,976.160	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	76,079,000.000	78,370,316.880	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	80,425,000.000	90,812,693.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	34,145,000.000	39,740,682.600	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	46,168,000.000	51,710,006.720	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	20,241,000.000	23,535,222.750	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	61,170,000.000	68,279,789.100	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	44,316,000.000	50,693,072.400	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	60,173,000.000	66,076,573.030	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	71,661,000.000	86,617,367.310	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	40,503,000.000	49,052,373.240	
メキシコ・ペソ 小計		723,061,000.000 (3,759,917,200)	816,641,443.380 (4,246,535,506)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	2,010,000.000	2,095,879.260	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	1,800,000.000	1,830,582.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	540,000.000	546,318.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	2,640,000.000	2,864,851.440	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	3,000,000.000	3,222,516.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	2,470,000.000	2,711,695.920	

AUSTRIA 0.75 03/20/51	1,260,000.000	1,518,759.900	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,150,000.000	3,416,247.450	
AUSTRIA 07/15/23	1,710,000.000	1,741,891.500	
AUSTRIA 07/15/24	1,970,000.000	2,021,917.380	
AUSTRIA 09/20/22	1,430,000.000	1,448,672.940	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	2,490,000.000	2,725,690.950	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	2,090,000.000	2,910,203.780	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	500,000.000	852,650.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	2,600,000.000	2,843,240.400	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	3,410,000.000	3,654,312.860	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,280,000.000	2,913,582.080	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,890,000.000	2,584,733.760	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,620,000.000	2,865,808.340	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	3,380,000.000	3,652,350.260	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	700,000.000	741,230.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	950,000.000	2,339,815.800	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,400,000.000	5,837,800.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,200,000.000	2,857,294.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,698,506.800	
BELGIUM 0.0 10/22/27	3,110,000.000	3,236,595.660	
BELGIUM 0.1 06/22/30	3,890,000.000	4,077,887.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	2,030,000.000	2,086,028.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	1,260,000.000	1,332,998.100	
BELGIUM 0.5 10/22/24	3,420,000.000	3,584,615.870	
BELGIUM 0.8 06/22/25	3,730,000.000	3,988,227.900	
BELGIUM 0.8 06/22/27	2,630,000.000	2,876,562.500	
BELGIUM 0.8 06/22/28	3,360,000.000	3,706,080.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	4,270,000.000	4,781,272.720	
BELGIUM 1.0 06/22/26	3,770,000.000	4,121,492.180	
BELGIUM 1.0 06/22/31	4,130,000.000	4,724,307.000	
BELGIUM 1.25 04/22/33	1,850,000.000	2,201,886.650	
BELGIUM 1.45 06/22/37	1,000,000.000	1,245,340.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	2,530,000.000	3,381,937.020	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,850,000.000	2,568,384.600	
BELGIUM 1.9 06/22/38	2,160,000.000	2,880,003.600	
BELGIUM 2.15 06/22/66	1,690,000.000	2,875,704.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	3,800,000.000	4,091,760.200	
BELGIUM 2.25 06/22/57	1,400,000.000	2,289,306.600	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,630,000.000	2,944,127.200	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,420,000.000	2,039,849.880	
BELGIUM 3.75 06/22/45	2,410,000.000	4,440,181.590	
BELGIUM 4.0 03/28/22	3,190,000.000	3,386,388.190	
BELGIUM 4.0 03/28/32	2,350,000.000	3,517,151.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	3,690,000.000	6,745,482.360	
BELGIUM 4.25 09/28/22	3,880,000.000	4,231,547.400	
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,460,000.000	3,145,161.660	
BELGIUM 5.0 03/28/35	4,750,000.000	8,309,550.250	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,560,000.000	5,170,152.400	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	5,300,000.000	5,485,574.200	

BUNDESUBL 0.0 10/10/25	5,300,000.000	5,504,103.000	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	1,000,000.000	1,038,580.000	
BUNDESUBL 04/05/24	5,380,000.000	5,527,008.500	
BUNDESUBL 04/08/22	3,300,000.000	3,332,835.000	
BUNDESUBL 04/14/23	6,220,000.000	6,339,007.260	
BUNDESUBL 10/07/22	6,150,000.000	6,239,585.820	
BUNDESUBL 10/13/23	4,800,000.000	4,912,032.000	
BUNDESUBL 10/18/24	4,740,000.000	4,887,902.220	
BUNDESSCHAT 0.0 03/11/22	3,000,000.000	3,028,410.000	
BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	5,230,000.000	5,300,343.500	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/22	3,000,000.000	3,046,739.700	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	5,290,000.000	5,605,707.200	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	5,870,000.000	6,230,300.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	5,810,000.000	6,159,122.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,500,000.000	1,593,555.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,510,000.000	3,709,427.670	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	6,280,000.000	6,599,275.200	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,970,000.000	8,482,471.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	7,800,000.000	8,414,718.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	7,500,000.000	8,070,225.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	7,590,000.000	8,010,637.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	7,250,000.000	7,744,522.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	6,940,000.000	7,570,568.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	7,410,000.000	8,047,689.780	
DEUTSCHLAND 08/15/26	7,690,000.000	8,041,179.230	
DEUTSCHLAND 08/15/29	5,620,000.000	5,950,360.460	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	5,400,000.000	5,766,449.400	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	6,240,000.000	6,774,081.600	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	5,030,000.000	7,133,037.970	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	5,050,000.000	5,306,709.680	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	8,090,000.000	8,548,306.590	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	5,000,000.000	5,402,450.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	4,600,000.000	4,784,139.380	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	6,640,000.000	7,188,649.920	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	7,280,000.000	7,571,163.600	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,230,000.000	2,295,651.200	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	6,580,000.000	7,081,264.400	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	7,010,000.000	11,809,116.100	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	9,410,000.000	16,303,590.960	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,130,000.000	7,457,995.300	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	6,150,000.000	10,700,366.550	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	4,150,000.000	7,864,582.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,380,000.000	3,401,615.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,320,000.000	9,268,770.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	5,060,000.000	10,341,122.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,270,000.000	8,634,526.100	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	4,680,000.000	6,856,293.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,438,892.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,309,706.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,488,667.400	
FINLAND 0.0 09/15/24	1,150,000.000	1,182,159.750	
FINLAND 0.0 09/15/30	520,000.000	542,049.560	
FINLAND 0.125 04/15/36	890,000.000	933,414.200	
FINLAND 0.25 09/15/40	730,000.000	779,943.310	
FINLAND 0.5 04/15/26	1,260,000.000	1,341,664.380	
FINLAND 0.5 09/15/27	1,960,000.000	2,110,314.360	
FINLAND 0.5 09/15/28	890,000.000	964,714.610	
FINLAND 0.5 09/15/29	1,660,000.000	1,808,505.260	
FINLAND 0.75 04/15/31	710,000.000	797,210.010	
FINLAND 0.875 09/15/25	1,190,000.000	1,281,740.180	
FINLAND 04/15/22	1,010,000.000	1,020,211.100	
FINLAND 09/15/23	800,000.000	816,737.680	
FINLAND 1.125 04/15/34	980,000.000	1,164,828.000	
FINLAND 1.375 04/15/47	870,000.000	1,200,045.810	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,190,000.000	1,253,248.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	1,010,000.000	1,052,723.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	1,620,000.000	1,770,670.200	
FINLAND 2.625 07/04/42	1,080,000.000	1,729,620.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,180,000.000	1,484,322.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,440,000.000	1,756,172.160	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,806,799.090	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	6,300,000.000	6,400,485.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	7,460,000.000	7,712,192.760	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	9,100,000.000	9,452,233.700	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	6,840,000.000	7,085,980.080	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	7,960,000.000	8,381,227.280	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	16,400,000.000	17,292,488.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	9,020,000.000	9,598,452.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	9,390,000.000	10,176,224.700	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,500,000.000	2,705,332.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	9,540,000.000	10,472,535.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,790,000.000	4,242,590.430	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	11,340,000.000	12,497,814.000	

FRANCE OAT 02/25/22	810,000.000	817,073.480	
FRANCE OAT 03/25/23	8,940,000.000	9,091,425.720	
FRANCE OAT 03/25/24	9,300,000.000	9,525,106.500	
FRANCE OAT 03/25/25	9,980,000.000	10,281,485.820	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,559,730.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	8,120,000.000	8,975,588.160	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	8,820,000.000	9,565,731.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	11,020,000.000	13,165,193.960	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	7,440,000.000	8,968,920.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	12,300,000.000	14,711,046.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	9,050,000.000	12,112,067.500	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	10,570,000.000	11,221,048.580	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,870,000.000	4,426,582.660	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	8,810,000.000	11,678,095.500	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	8,470,000.000	9,311,790.950	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	5,880,000.000	8,602,010.760	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	8,220,000.000	9,078,562.560	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	9,150,000.000	9,667,798.500	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	10,610,000.000	13,591,993.550	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	13,100,000.000	16,172,238.200	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	13,130,000.000	13,802,912.500	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	7,760,000.000	13,452,472.160	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	9,840,000.000	12,076,140.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	3,610,000.000	7,862,941.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	4,220,000.000	9,765,312.100	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	5,670,000.000	9,793,705.950	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	14,420,000.000	16,515,730.700	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	7,490,000.000	14,238,490.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,630,000.000	9,681,269.180	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,440,000.000	12,774,594.090	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	6,830,000.000	11,834,381.980	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	2,957,934.660	
IRISH 0.2 05/15/27	1,860,000.000	1,947,001.500	
IRISH 0.2 10/18/30	1,900,000.000	1,995,874.370	
IRISH 0.4 05/15/35	1,860,000.000	1,992,417.120	
IRISH 0.8 03/15/22	620,000.000	631,715.890	
IRISH 0.9 05/15/28	1,970,000.000	2,173,015.190	
IRISH 1.0 05/15/26	3,150,000.000	3,427,956.000	
IRISH 1.1 05/15/29	1,670,000.000	1,885,288.050	
IRISH 1.3 05/15/33	480,000.000	570,455.040	
IRISH 1.35 03/18/31	1,180,000.000	1,383,296.300	
IRISH 1.5 05/15/50	1,210,000.000	1,616,409.960	
IRISH 1.7 05/15/37	1,180,000.000	1,513,661.520	
IRISH 10/18/22	1,080,000.000	1,094,524.050	
IRISH 2.0 02/18/45	2,260,000.000	3,240,528.120	
IRISH 2.4 05/15/30	2,420,000.000	3,059,276.880	
IRISH 3.4 03/18/24	1,340,000.000	1,520,684.260	
IRISH 3.9 03/20/23	1,750,000.000	1,934,180.500	
IRISH 5.4 03/13/25	2,860,000.000	3,605,361.760	

ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,290,000.000	1,301,223.000	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23	500,000.000	505,126.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	4,400,000.000	4,476,120.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	4,500,000.000	4,599,913.500	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	3,400,000.000	3,490,764.700	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	4,500,000.000	4,612,500.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	5,110,000.000	5,258,169.560	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	4,000,000.000	4,178,200.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,560,000.000	1,612,440.960	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	2,500,000.000	2,555,525.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	5,000,000.000	5,150,705.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	4,210,000.000	4,340,510.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	5,220,000.000	5,452,290.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	4,100,000.000	4,305,820.000	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	3,050,000.000	3,122,565.600	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,758,482.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	4,200,000.000	4,493,928.600	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	5,220,000.000	5,652,680.580	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	3,072,360.000	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	3,070,000.000	3,295,031.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	3,600,000.000	3,851,694.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	4,140,000.000	4,280,644.080	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	4,730,000.000	5,039,972.980	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	4,550,000.000	4,883,134.620	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	4,790,000.000	5,208,646.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	5,620,000.000	6,233,389.280	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	6,820,000.000	7,562,056.920	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,700,000.000	1,804,050.200	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,140,000.000	4,433,140.980	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	2,300,000.000	2,540,580.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	4,440,000.000	4,759,680.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	4,380,000.000	4,770,696.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	5,650,000.000	6,352,870.730	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	4,400,000.000	4,853,831.400	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,000,000.000	5,615,600.000	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	3,720,000.000	4,149,669.300	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,010,000.000	2,063,626.800	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	5,500,000.000	6,217,750.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	3,200,000.000	3,806,720.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	5,340,000.000	6,423,491.340	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	4,270,000.000	5,321,274.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	6,030,000.000	6,508,643.310	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	4,770,000.000	5,375,074.500	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,290,000.000	5,857,331.860	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	3,340,000.000	4,323,630.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	2,100,000.000	2,806,650.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	4,550,000.000	5,435,525.550	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	4,130,000.000	5,369,826.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,900,000.000	5,986,692.600	

ITALY BTPS 3.1 03/01/40	3,330,000.000	4,442,809.410	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,850,000.000	5,444,838.630	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	3,370,000.000	4,483,414.300	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	3,450,000.000	5,069,909.550	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,860,000.000	7,482,053.860	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	5,380,000.000	6,177,305.240	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	3,860,000.000	6,091,137.900	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	6,390,000.000	9,223,326.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	4,042,353.350	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	7,300,000.000	9,017,690.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	6,130,000.000	6,852,910.900	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	7,620,000.000	8,664,702.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	7,310,000.000	9,777,929.100	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	4,530,000.000	7,722,298.240	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,810,000.000	2,997,427.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	5,750,000.000	7,007,864.250	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	7,140,000.000	10,984,176.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	5,290,000.000	8,750,718.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	4,940,000.000	8,251,282.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	5,850,000.000	8,329,815.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,263,636.800	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	6,610,000.000	7,349,546.630	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	5,320,000.000	8,416,240.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,641,350.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,855,540.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	3,057,730.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,161,210.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	2,870,000.000	2,989,363.300	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,400,000.000	1,456,077.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	3,700,000.000	3,889,380.800	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	3,360,000.000	3,516,374.400	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	3,250,000.000	3,488,082.000	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	2,430,000.000	2,802,934.530	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	3,640,000.000	3,889,522.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	3,370,000.000	3,691,792.870	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	3,100,000.000	3,432,905.900	
NETHERLANDS 01/15/22	2,190,000.000	2,207,568.180	
NETHERLANDS 01/15/24	4,260,000.000	4,361,643.600	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	5,030,000.000	5,361,390.980	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	3,690,000.000	4,060,649.430	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	3,780,000.000	3,961,485.360	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,330,000.000	4,552,016.760	

NETHERLANDS 2.75 01/15/47	4,160,000.000	7,483,777.600	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,670,000.000	1,829,819.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,540,000.000	6,647,624.400	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,360,000.000	5,789,280.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	3,220,000.000	4,653,866.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	692,955.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	4,800,000.000	4,898,640.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	960,000.000	980,870.400	
SPAIN 0.0 04/30/23	8,000,000.000	8,112,800.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	3,450,000.000	3,551,525.220	
SPAIN 0.35 07/30/23	5,300,000.000	5,429,108.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,346,662.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	4,540,000.000	4,629,142.900	
SPAIN 0.5 04/30/30	5,240,000.000	5,502,906.520	
SPAIN 0.6 10/31/29	5,420,000.000	5,750,435.720	
SPAIN 0.8 07/30/27	5,200,000.000	5,575,960.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	2,990,000.000	3,115,005.920	
SPAIN 1.2 10/31/40	2,200,000.000	2,449,939.800	
SPAIN 1.25 10/31/30	6,770,000.000	7,595,940.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	5,510,000.000	6,063,000.130	
SPAIN 1.4 04/30/28	6,750,000.000	7,560,517.710	
SPAIN 1.4 07/30/28	6,500,000.000	7,304,050.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	6,120,000.000	6,930,967.320	
SPAIN 1.45 10/31/27	5,760,000.000	6,441,716.720	
SPAIN 1.5 04/30/27	5,220,000.000	5,833,872.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	5,810,000.000	6,350,030.780	
SPAIN 1.85 07/30/35	4,270,000.000	5,191,487.350	
SPAIN 1.95 04/30/26	4,990,000.000	5,633,742.930	
SPAIN 1.95 07/30/30	5,130,000.000	6,104,604.050	
SPAIN 2.15 10/31/25	7,190,000.000	8,119,659.810	
SPAIN 2.35 07/30/33	4,740,000.000	5,990,412.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	4,430,000.000	6,545,164.180	
SPAIN 2.75 10/31/24	5,130,000.000	5,791,429.360	
SPAIN 2.9 10/31/46	3,690,000.000	5,562,046.220	
SPAIN 3.45 07/30/66	3,200,000.000	5,861,239.350	
SPAIN 3.8 04/30/24	3,600,000.000	4,136,771.150	
SPAIN 4.2 01/31/37	4,460,000.000	7,131,422.700	
SPAIN 4.4 10/31/23	5,280,000.000	6,044,163.840	
SPAIN 4.65 07/30/25	4,820,000.000	5,981,315.840	
SPAIN 4.7 07/30/41	4,600,000.000	8,281,973.850	
SPAIN 4.8 01/31/24	4,950,000.000	5,791,064.400	
SPAIN 4.9 07/30/40	5,110,000.000	9,266,474.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	4,410,000.000	6,276,312.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	3,940,000.000	7,817,905.600	
SPAIN 5.4 01/31/23	6,060,000.000	6,840,497.700	
SPAIN 5.75 07/30/32	4,820,000.000	7,958,181.500	

	SPAIN 5.85 01/31/22	2,160,000.000	2,318,529.310	
	SPAIN 5.9 07/30/26	4,440,000.000	6,033,671.400	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,261,455.500	
	ユーロ 小計	1,407,280,000.000 (177,725,391,200)	1,709,911,816.880 (215,944,763,354)	
国債証券 合計		448,902,127,300 (448,902,127,300)	517,312,366,830 (517,312,366,830)	
合計			517,312,366,830 (517,312,366,830)	

(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 239銘柄	42.63	43.13
イギリス・ポンド	国債証券 47銘柄	6.58	6.66
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.41	0.42
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	2.66	2.69
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	1.96	1.98
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.42	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.30	0.31
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.50	0.51
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.21	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	0.61	0.62
マレーシア・リングギット	国債証券 31銘柄	0.47	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.81	0.82
ユーロ	国債証券 327銘柄	41.26	41.74

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,290,424,316
投資信託受益証券	6,041,198,080
投資証券	44,456,065,261
派生商品評価勘定	3,962,910
未収入金	1,757,738,930
未収配当金	62,052,689
流動資産合計	53,611,442,186
資産合計	53,611,442,186
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,345,155
前受金	61,961,537
未払金	61,694,300
未払解約金	2,770,988,000
流動負債合計	2,895,988,992
負債合計	2,895,988,992
純資産の部	
元本等	
元本	42,845,368,442
剰余金	
剰余金又は欠損金()	7,870,084,752
元本等合計	50,715,453,194
純資産合計	50,715,453,194
負債純資産合計	53,611,442,186

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	31,731,378,039円
同期中追加設定元本額	35,487,311,898円
同期中一部解約元本額	24,373,321,495円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	60,580,786円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	30,584,834円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	5,944,499円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	16,689,823円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	16,811,732円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	55,320,003円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	46,024,721円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,583,208円
たわらノーロード 先進国リート	7,495,981,251円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,412,460,985円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	315,254,740円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,380,104,319円
たわらノーロード バランス(堅実型)	13,006,007円

たわらノーロード バランス(標準型)	220,683,812円
たわらノーロード バランス(積極型)	421,050,608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)	62,758,014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)	280,146,459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)	212,533,383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)	324,345,821円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,199,418円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	6,338,637円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,793,371円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	9,582,176円
One DC 先進国リートインデックスファンド	373,822,806円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	19,974,452円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	614,287,750円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	54,446,524円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	229,297,790円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	258,547,175円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	476,110,278円
投資のソムリエ	10,554,817,271円
投資のソムリエ<DC年金>	726,898,537円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	208,590,169円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	394,669,641円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,181,019,247円
ワールドアセットバランス(基本コース)	812,123,062円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,056,714,046円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	19,463,641円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,150,103円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,820,172円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	33,007,094円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,005,947,345円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	192,433,025円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,113,782円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,828,692円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,964,120円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	630,286,470円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	122,662,718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)	8,740,877円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	624,536,740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)	10,730,823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)	104,446,576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)	5,657,795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)	14,468,597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)	180,522,635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)	397,671,697円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,650,204,051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)	1,879,914,082円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	555,700,052円
計	42,845,368,442円

2. 受益権の総数	42,845,368,442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 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2020年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2020年12月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資信託受益証券	318,870,306	
投資証券	2,341,441,075	
合計	2,660,311,381	

(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(2020年6月23日から2020年12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	1,581,727,110	-	1,579,108,600	2,618,510
イギリス・ポンド	1,161,567,800	-	1,158,560,000	3,007,800
オーストラリア・ドル	96,234,990	-	95,406,300	828,690
カナダ・ドル	116,427,000	-	117,435,000	1,008,000
シンガポール・ドル	27,660,020	-	27,733,800	73,780
ニュージーランド・ドル	62,394,400	-	62,352,000	42,400
ユーロ	7,318,700	-	7,372,000	53,300
ユーロ	81,879,200	-	82,088,500	209,300
香港・ドル	28,245,000	-	28,161,000	84,000
買建	37,880,655	-	37,879,900	755
アメリカ・ドル	31,200,225	-	31,200,000	225
イギリス・ポンド	2,765,380	-	2,765,400	20
オーストラリア・ドル	3,915,050	-	3,914,500	550
合計	1,619,607,765	-	1,616,988,500	2,617,755

(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)

2020年12月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1837円 (11,837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

2020年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	286,000.000	207,350.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	536,400.000	399,618.000		
		PRIME US REIT	167,500.000	130,650.000		
		アメリカ・ドル	小計	1,062,600.000	737,618.000 (76,719,648)	
	オーストラリア・ドル		ABACUS PROPERTY GROUP	135,272.000	401,757.840	
			APN INDUSTRIA REIT	48,347.000	142,623.650	
			ARENA REIT	138,744.000	395,420.400	
			AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	139,383.000	365,183.460	
			BWP TRUST	199,552.000	858,073.600	
			CENTURIA CAPITAL GROUP	191,829.000	479,572.500	
			CENTURIA INDUSTRIAL REIT	174,158.000	534,665.060	
			CENTURIA OFFICE REIT	166,759.000	356,864.260	
			CHARTER HALL GROUP	183,230.000	2,607,362.900	
			CHARTER HALL LONG WALE REIT	169,317.000	790,710.390	
			CHARTER HALL RETAIL REIT	199,019.000	742,340.870	
			CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	136,121.000	431,503.570	
			CROMWELL PROPERTY GROUP	760,998.000	677,288.220	
			DEXUS	430,282.000	4,165,129.760	
			GDI PROPERTY GROUP	215,534.000	245,708.760	
		GOODMAN GROUP	657,773.000	11,938,579.950		
	GPT GROUP	767,651.000	3,607,959.700			
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	111,487.000	394,663.980			
	HOME CONSORTIUM LTD	60,660.000	235,360.800			
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	30,330.000	37,912.500			
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	58,989.000	185,815.350			
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	119,129.000	564,671.460			

	IRONGATE GROUP	238,350.000	300,321.000	
	MIRVAC GROUP	1,551,258.000	4,188,396.600	
	NATIONAL STORAGE REIT	386,749.000	792,835.450	
	RURAL FUNDS GROUP	140,175.000	344,830.500	
	SCENTRE GROUP	2,049,096.000	5,778,450.720	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	431,247.000	1,116,929.730	
	STOCKLAND	940,150.000	4,127,258.500	
	VICINITY CENTRES	1,514,746.000	2,605,363.120	
	WAYPOINT REIT LTD	312,734.000	869,400.520	
	オーストラリア・ドル 小計	12,659,069.000	50,282,955.120 (3,937,155,386)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	168,495.000	202,194.000	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	358,680.000	211,621.200	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,248,060.000	3,594,412.800	
	ASCOTT TRUST	719,216.000	762,368.960	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,783,809.000	3,728,160.810	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	387,680.000	503,984.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	284,900.000	364,672.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	127,400.000	91,728.000	
	ESR REIT	980,130.000	396,952.650	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	430,600.000	266,972.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	300,800.000	126,336.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	388,200.000	927,798.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	286,700.000	157,685.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,073,064.000	1,437,905.760	
	IREIT GLOBAL	214,500.000	137,280.000	
	KEPPEL DC REIT	513,100.000	1,395,632.000	
	KEPPEL REIT	652,800.000	691,968.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	339,200.000	242,528.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	611,800.000	51,391.200	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	856,000.000	1,771,920.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	654,320.000	1,832,096.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,033,020.000	1,962,738.000	

		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	792,200.000	740,707.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	983,955.000	378,822.670	
		PARKWAY LIFE REIT	149,000.000	569,180.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	313,200.000	109,620.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	189,200.000	157,036.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	342,600.000	174,726.000	
		SPH REIT	412,500.000	344,437.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	570,500.000	273,840.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	857,790.000	1,278,107.100	
	シンガポール・ドル 小計		18,023,419.000	24,884,820.650 (1,939,771,770)	
	ユーロ	CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	546,100.000	253,936.500	
	ユーロ 小計		546,100.000	253,936.500 (32,069,641)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	575,000.000	4,134,250.000	
	香港・ドル 小計		575,000.000	4,134,250.000 (55,481,635)	
投資信託受益証券 合計			32,866,188	6,041,198,080 (6,041,198,080)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,038.000	516,460.120	
		AGREE REALTY CORP	21,794.000	1,416,827.940	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	29,578.000	483,600.300	
		ALEXANDER'S INC.	892.000	251,240.720	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	46,571.000	7,964,106.710	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	19,325.000	568,734.750	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	54,200.000	2,306,210.000	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	44,862.000	347,680.500	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	105,106.000	3,055,431.420	
		AMERICOLD REALTY TRUST	80,245.000	2,698,639.350	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	62,174.000	2,535,455.720	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	83,772.000	1,094,900.040	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	24,198.000	263,274.240	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	55,873.000	9,080,479.960	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	10,643.000	123,671.660	

BOSTON PROPERTIES INC	55,945.000	5,700,795.500	
BRANDYWINE REALTY TRUST	66,469.000	773,034.470	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	116,604.000	1,884,320.640	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	21,083.000	334,587.210	
BRT APARTMENTS CORP	3,832.000	56,138.800	
CAMDEN PROPERTY TRUST	38,433.000	3,685,340.370	
CARETRUST REIT INC	37,313.000	785,438.650	
CHATHAM LODGING TRUST	20,307.000	242,465.580	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	4,617.000	55,681.020	
CITY OFFICE REIT INC	19,187.000	185,154.550	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	34,177.920	
COLONY CAPITAL INC	188,099.000	916,042.130	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	44,459.000	645,989.270	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,767.000	414,591.430	
CORECIVIC INC	49,570.000	374,253.500	
COREPOINT LODGING INC	13,648.000	94,990.080	
CORESITE REALTY CORP	16,738.000	1,983,285.620	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	45,320.000	1,163,817.600	
COUSINS PROPERTIES INC	58,443.000	1,984,139.850	
CUBESMART	76,317.000	2,484,118.350	
CYRUSONE INC	46,088.000	3,080,521.920	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	77,532.000	648,942.840	
DIGITAL REALTY TRUST INC	106,740.000	13,839,908.400	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	97,816.000	431,368.560	
DOUGLAS EMMETT INC	64,870.000	2,044,053.700	
DUKE REALTY TRUST	146,376.000	5,597,418.240	
EAST GROUP	15,479.000	2,051,896.240	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	30,983.000	666,444.330	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	54,493.000	537,845.910	
EPR PROPERTIES	30,068.000	1,017,501.120	
EQUINIX INC	35,127.000	24,131,897.730	
EQUITY COMMONWEALTH	49,142.000	1,296,365.960	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	66,860.000	3,975,495.600	
EQUITY RESIDENTIAL	135,960.000	8,129,048.400	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	39,741.000	818,267.190	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,902.000	6,356,609.820	
EXTRA SPACE STORAGE INC	50,987.000	5,609,589.740	

FARMLAND PARTNERS INC	9,378.000	79,619.220	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	27,112.000	2,478,850.160	
FIRST INDUSTRIAL RT	50,064.000	2,057,630.400	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	27,422.000	794,141.120	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	40,943.000	196,526.400	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	20,113.000	325,629.470	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	81,811.000	3,499,056.470	
GEO GROUP INC	46,767.000	437,271.450	
GETTY REALTY CORP	14,455.000	416,014.900	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14,506.000	264,009.200	
GLADSTONE LAND CORP	8,606.000	126,680.320	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17,764.000	255,091.040	
GLOBAL NET LEASE INC	36,138.000	618,682.560	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	53,450.000	1,577,309.500	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	86,040.000	2,229,296.400	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	212,708.000	6,283,394.320	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,618.000	147,900.200	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	40,814.000	1,612,153.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	278,384.000	4,128,434.720	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	60,238.000	1,572,211.800	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	38,365.000	506,034.350	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,374.000	599,217.280	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,779.000	1,414,999.220	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	5,275.000	380,116.500	
INVITATION HOMES INC	222,014.000	6,418,424.740	
IRON MOUNTAIN INC	113,663.000	3,442,852.270	
JBG SMITH PROPERTIES	45,494.000	1,438,520.280	
KILROY REALTY CORP	41,294.000	2,519,759.880	
KIMCO REALTY	170,390.000	2,525,179.800	
KITE REALTY GROUP TRUST	32,526.000	498,298.320	
LEXINGTON REALTY TRUST	111,815.000	1,190,829.750	
LIFE STORAGE INC	18,464.000	2,075,353.600	
LTC PROPERTIES INC	15,851.000	602,655.020	
MACK CALI	33,213.000	444,389.940	

MEDICAL PROPERTIES TRUST	208,760.000	4,277,492.400	
MID AMERICA	45,175.000	5,429,131.500	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	39,559.000	602,087.980	
NATIONAL HEALTH INVS INC	18,041.000	1,198,463.630	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	68,386.000	2,694,408.400	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	24,148.000	821,273.480	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	33,944.000	204,682.320	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,985.000	384,647.850	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	19,771.000	466,200.180	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	89,528.000	3,341,184.960	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,480.000	113,490.800	
PARAMOUNT GROUP INC	65,409.000	613,536.420	
PARK HOTELS & RESORTS INC	92,578.000	1,681,216.480	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	51,165.000	965,483.550	
PHYSICIANS REALTY TRUST	82,483.000	1,462,423.590	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	49,135.000	796,478.350	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,278.000	137,725.200	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	20,886.000	169,803.180	
PROLOGIS INC	293,019.000	28,475,586.420	
PS BUSINESS PARKS	8,101.000	1,082,050.570	
PUBLIC STORAGE	60,349.000	13,070,386.420	
QTS REALTY TRUST INC	24,821.000	1,454,014.180	
REALTY INCOME CORP	136,995.000	8,210,110.350	
REGENCY CENTERS CORP	62,194.000	2,961,056.340	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	45,801.000	632,053.800	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	83,451.000	751,059.000	
RETAIL VALUE INC	5,389.000	79,056.630	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	48,747.000	2,272,585.140	
RLJ LODGING TRUST	64,453.000	872,693.620	
RPT REALTY	34,047.000	280,547.280	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	22,253.000	1,516,764.480	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	83,231.000	1,456,542.500	
SAFEHOLD INC	5,688.000	394,519.680	

	SAUL CENTERS INC	5,164.000	170,412.000	
	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	15,439.000	264,624.460	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	64,201.000	808,932.600	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	129,079.000	11,673,904.760	
	SITE CENTERS CORP	58,448.000	603,183.360	
	SL GREEN	28,800.000	1,784,160.000	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	40,484.000	1,633,934.240	
	STAG INDUSTRIAL INC	58,637.000	1,776,701.100	
	STORE CAPITAL CORP	89,920.000	2,927,795.200	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	43,627.000	414,456.500	
	SUN COMMUNITIES INC	38,821.000	5,446,198.090	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	84,251.000	911,595.820	
	TANGER FACTORY OUTLET	38,629.000	424,919.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	24,146.000	1,036,104.860	
	TERRENO REALTY CORP	26,832.000	1,508,495.040	
	THE MACERICH COMPANY	45,624.000	547,488.000	
	UDR INC	116,503.000	4,465,559.990	
	UMH PROPERTIES INC	16,392.000	249,486.240	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,301.000	363,701.610	
	URBAN EDGE PROPERTIES	44,344.000	628,797.920	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	13,261.000	192,019.280	
	VENTAS INC	148,161.000	7,234,701.630	
	VEREIT INC	425,102.000	3,209,520.100	
	VICI PROPERTIES INC	210,785.000	5,360,262.550	
	VORNADO REALTY TRUST	61,744.000	2,451,854.240	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	89,326.000	95,578.820	
	WASHINGTON REIT	32,074.000	741,871.620	
	WEINGARTEN REALTY INVST	47,112.000	1,062,375.600	
	WELLTOWER INC	165,631.000	10,605,352.930	
	WHITESTONE REIT	17,850.000	150,832.500	
	WP CAREY INC	68,669.000	4,710,006.710	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	44,214.000	672,937.080	
アメリカ・ドル	小計	8,876,341.000	352,891,305.800 (36,704,224,715)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	54,933.000	41,089.880	
	ASSURA PLC	1,073,000.000	771,487.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	66,496.000	716,826.880	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	305,418.000	242,807.310	
	BRITISH LAND CO PLC	370,888.000	1,826,623.400	

	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	332,032.000	495,059.710	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	254,272.000	262,408.700	
	CUSTODIAN REIT PLC	170,414.000	149,112.250	
	DERWENT LONDON PLC	44,029.000	1,363,137.840	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	252,342.000	185,471.370	
	GCP STUDENT LIVING PLC	188,665.000	265,262.990	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	102,217.000	664,001.630	
	HAMMERSON PLC	1,488,511.000	381,058.810	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	120,448.000	130,083.840	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	3,927.680	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	296,106.000	2,102,352.600	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	366,593.000	823,367.870	
	LXI REIT PLC	198,726.000	234,099.220	
	NEWRIVER REIT PLC	132,864.000	111,472.890	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	207,754.000	156,438.760	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	529,874.000	754,540.570	
	RDI REIT PLC	114,891.000	98,806.260	
	REGIONAL REIT LTD	160,485.000	124,215.390	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	81,673.000	607,647.120	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	197,180.000	73,942.500	
	SEGRO PLC	473,161.000	4,279,268.080	
	SHAFTESBURY PLC	94,508.000	540,113.220	
	STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	179,591.000	101,648.500	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	271,782.000	288,088.920	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	148,874.000	157,062.070	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	669,960.000	1,036,428.120	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	304,490.000	211,925.040	
	UNITE GROUP PLC	156,769.000	1,660,183.710	
	WORKSPACE GROUP PLC	49,468.000	364,579.160	
	イギリス・ボンド 小計	9,689,454.000	21,224,539.290 (2,934,929,293)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	74,336.000	1,185,659.200	
	イスラエル・シュケル 小計	74,336.000	1,185,659.200 (37,881,811)	

カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	24,237.000	965,117.340	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,865.000	303,449.850	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,088.000	77,259.200	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,978.000	313,960.660	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	33,163.000	1,652,180.660	
	CHOICE PROPERTIES REIT	64,213.000	859,169.940	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	33,600.000	289,968.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	19,359.000	286,513.200	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,298.000	323,942.580	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	28,395.000	363,456.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,379.000	242,600.280	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,668.000	599,853.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,026.000	932,496.040	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	56,274.000	787,836.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	25,597.000	354,006.510	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,738.000	360,633.820	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,391.000	126,861.350	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,583.000	138,272.130	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,852.000	410,650.000	
	PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	72,138.500	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	62,564.000	1,082,357.200	
	SLATE GROCERY REIT	6,629.000	76,498.660	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	48,630.120	
	SMARTCENTRES REIT	27,395.000	650,631.250	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	29,495.000	385,794.600		
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	17,630.000	112,303.100		
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,004.000	286,951.720		
カナダ・ドル 小計	674,666.000	12,103,531.710 (987,406,117)		

ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	333,667.000	513,847.180	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	427,794.000	1,011,732.810	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	625,880.000	744,797.200	
	PRECINCT PROPERTIES	434,438.000	738,544.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	131,744.000	395,232.000	
ニュージーランド・ドル 小計		1,953,523.000	3,404,153.790 (250,988,259)	
ユーロ	AEDIFICA	12,955.000	1,224,247.500	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	70,044.000	1,014,237.120	
	ALTAREA	1,468.000	196,124.800	
	BEFIMMO	9,915.000	390,155.250	
	CARE PROPERTY INVEST NV	10,295.000	277,450.250	
	CARMILA SA	19,776.000	235,334.400	
	COFINIMMO SA	10,631.000	1,294,855.800	
	COVIVIO	18,947.000	1,415,340.900	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,563.000	223,396.420	
	GECINA SA	21,328.000	2,712,921.600	
	HAMBORNER REIT AG	27,972.000	249,985.760	
	HIBERNIA REIT PLC	268,496.000	308,770.400	
	ICADE	12,135.000	788,775.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	22,255.000	83,011.150	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	99,351.000	800,769.060	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,580.000	216,029.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	171,288.000	242,543.800	
	KLEPIERRE	81,699.000	1,542,885.610	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	25,685.000	124,315.400	
	MERCIALYS	16,204.000	113,590.040	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	132,465.000	1,050,447.450	
	MONTEA SCA	4,073.000	373,086.800	
	NSI NV	6,554.000	216,609.700	
	RETAIL ESTATES	4,338.000	251,604.000	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	54,573.000	3,345,324.900		
VASTNED RETAIL	7,759.000	178,069.050		
WAREHOUSES DE PAUW	51,511.000	1,434,066.240		
WERELDHAVE NV	16,192.000	187,503.360		
XIOR STUDENT HOUSING NV	5,557.000	281,184.200		
ユーロ 小計		1,207,609.000	20,772,634.960 (2,623,376,069)	
韓国・ウォン	LOTTE REIT CO LTD	34,705.000	181,507,150.000	

	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	32,398.000	131,535,880.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	16,057.000	114,646,980.000	
韓国・ウォン 小計		83,160.000	427,690,010.000 (41,015,472)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	748,070.000	3,358,834.300	
	LINK REIT	817,420.000	56,810,690.000	
	PROSPERITY REIT	519,000.000	1,281,930.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	420,000.000	1,604,400.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	600,000.000	2,238,000.000	
香港・ドル 小計		3,104,490.000	65,293,854.300 (876,243,525)	
投資証券 合計		25,663,579	44,456,065,261 (44,456,065,261)	
合計			50,497,263,341 (50,497,263,341)	

(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 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 4銘柄	0.15	-	72.84
	投資証券 151銘柄	-	72.37	
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-	5.79	5.81
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-	0.07	0.08
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	7.76	-	7.80
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-	1.95	1.96
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	3.82	-	3.84
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-	0.49	0.50
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	0.06	-	5.26
	投資証券 29銘柄	-	5.17	
韓国・ウォン	投資証券 3銘柄	-	0.08	0.08
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.11	-	1.85
	投資証券 5銘柄	-	1.73	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,872,479,871
コール・ローン	135,854,117
株式	64,529,043,536
新株予約権証券	18,012
投資信託受益証券	402,415,524
投資証券	56,540,424
派生商品評価勘定	350,781,526
未収入金	632,499
未収配当金	16,249,633
差入委託証拠金	3,974,070,847
流動資産合計	71,338,085,989
資産合計	71,338,085,989
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	60,767
未払金	11,941,300
未払解約金	12,285,300
流動負債合計	24,287,367
負債合計	24,287,367
純資産の部	
元本等	
元本	53,984,941,006
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,328,857,616
元本等合計	71,313,798,622
純資産合計	71,313,798,622
負債純資産合計	71,338,085,989

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,924,152,899円
同期中追加設定元本額	39,419,789,246円
同期中一部解約元本額	18,359,001,139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>	6,839,233,009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)	242,823,128円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,580,748円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,723,304円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	7,351,181円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	24,800,658円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,634,823円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,053,553円
たわらノーロード 新興国株式	6,725,736,024円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,875,498,051円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,261,806,393円
たわらノーロード バランス(堅実型)	12,011,987円
たわらノーロード バランス(標準型)	40,245,519円
たわらノーロード バランス(積極型)	63,534,271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)	708,050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)	57,391,682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)	170,796,179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)	107,977,372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)	172,802,555円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	273,814円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	723,955円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,093,278円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,642,154円
たわらノーロード 全世界株式	41,677,205円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	78,181,784円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	446,123,110円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	365,824,715円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	394,205,940円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	723,162,409円
投資のソムリエ	16,578,324,094円
クルーズコントロール	911,442,491円
投資のソムリエ< D C 年金>	1,141,689,937円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	341,520,207円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	16,499,373円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	38,607,534円
投資のソムリエ< D C 年金> リスク抑制型	579,283,143円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,093,660,035円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,171,472,526円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,691,361,424円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	24,702,563円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,703,753円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	5,517,539円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	42,359,568円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,759,290,719円
9資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	289,230,409円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	11,577,705円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	6,128,727円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,273,673円
エマージング株式パッシブファンドV A (適格機関投資家専用)	19,848,782円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	364,017,843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)	179,812,110円
計	53,984,941,006円
2. 受益権の総数	53,984,941,006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 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2020年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2020年12月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	9,464,763,333	
新株予約権証券	55,346	
投資信託受益証券	69,710,025	
投資証券	6,607,350	
合計	9,541,025,362	

(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(2020年4月21日から2020年12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年12月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	6,352	-	6,354		2
サウジアラビア・リアル	6,352	-	6,354		2
買建	54,667,102	-	54,606,337		60,765
アメリカ・ドル	54,667,102	-	54,606,337		60,765
合計	54,673,454	-	54,612,691		60,767

(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	2020年12月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	6,124,876,913	-	6,475,658,439		350,781,526

合計	6,124,876,913	-	6,475,658,439	350,781,526
----	---------------	---	---------------	-------------

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2020年12月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		1.3210円 (13,210円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2020年12月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	38,212	34.210	1,307,232.520	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	16,135	12.780	206,205.300	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	5.340	129,281.400	
	CREDICORP LTD	5,678	162.720	923,924.160	
	SINA CORP	5,359	44.730	239,708.070	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	47,598	8.850	421,242.300	
	NETEASE INC-ADR	33,756	87.370	2,949,261.720	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,203	59.170	426,201.510	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	3,789	8.430	31,941.270	
	YPF SA ADR	4,248	5.540	23,533.920	
	LUKOIL SPON ADR	34,487	72.860	2,512,722.820	
	GAZPROM PAO ADR	485,101	5.256	2,549,690.850	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	131,927	3.870	510,557.490	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	54,736	0.757	41,435.150	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	80,784	4.842	391,156.120	
	51JOB INC ADR	2,130	73.250	156,022.500	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	11,427	39.120	447,024.240	
	NOVATEK PJSC GDR	7,636	170.700	1,303,465.200	
BAIDU INC -SPON ADR	22,075	158.320	3,494,914.000		

NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,650	27.340	345,851.000	
MMC NORILSK NICKEL ADR	54,079	32.730	1,770,005.670	
ROSNEFT OIL CO GDR	104,241	6.178	644,000.890	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,351	162.470	2,006,666.970	
SEVERSTAL GDR	18,579	16.330	303,395.070	
TATNEFT ADR	19,589	41.720	817,253.080	
VTB BANK OJSC GDR	152,000	1.022	155,344.000	
MAGNIT PJSC GDR	32,398	17.470	565,993.060	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	37,911	25.360	961,422.960	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	30,931	68.520	2,119,392.120	
MAIL.RU GROUP LTD GDR	8,092	28.600	231,431.200	
YANDEX NV	24,842	70.680	1,755,832.560	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,630	37.180	60,603.400	
SBERBANK ADR	222,728	15.790	3,516,875.120	
PHOSAGRO PJSC GDR	16,346	13.700	223,940.200	
HUAZHU GROUP LTD ADR	13,695	47.020	643,938.900	
JOYY INC-ADR	5,051	85.340	431,052.340	
GDS HOLDINGS LTD ADR	7,558	90.960	687,475.680	
ZAI LAB LTD ADR	5,993	111.720	669,537.960	
HUYA INC ADR	4,204	20.000	84,080.000	
BILIBILI INC ADR	10,488	75.710	794,046.480	
NIO INC ADR	87,316	45.220	3,948,429.520	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	32,245	18.610	600,079.450	
AUTOHOME INC ADR	5,151	97.580	502,634.580	
DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR	7,360	12.300	90,528.000	
GSX TECHEDU INC ADR	6,690	64.890	434,114.100	
WEIBO CORP ADR	5,182	40.810	211,477.420	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	4,238	45.140	191,303.320	
KE HOLDINGS INC ADR	7,937	68.000	539,716.000	
JD.COM INC ADR	70,449	81.710	5,756,387.790	
XPENG INC ADR	9,310	44.800	417,088.000	
LUFAX HOLDING LTD ADR	15,255	13.720	209,298.600	
GLOBANT SA	3,315	178.230	590,832.450	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	154,667	264.870	40,966,648.290	
MOMO INC SPON ADR	9,813	13.580	133,260.540	
BAOZUN INC-SPN ADR	5,357	35.870	192,155.590	
PINDUODUO INC ADR	30,994	154.340	4,783,613.960	
YUM CHINA HOLDINGS INC	31,979	57.360	1,834,315.440	
IQIYI INC ADR	19,644	21.780	427,846.320	
POLYUS PJSC GDR	5,920	98.100	580,752.000	
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	6,428	28.770	184,933.560	

	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	34,685	28.120	975,342.200	
	BEIGENE LTD ADR	3,603	227.950	821,303.850	
アメリカ・ドル	小計	2,369,385		101,245,720.180 (10,530,567,356)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	51,011	4.750	242,302.250	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	128,376	4.660	598,232.160	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	143,953	17.260	2,484,628.780	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	246,262	6.190	1,524,361.780	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	230,323	13.220	3,044,870.060	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,971	3.590	1,080,485.890	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	300,433	3.220	967,394.260	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	214,843	10.900	2,341,788.700	
	EMAAR MALLS PJSC	267,919	1.880	503,687.720	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	1,884,091		12,787,751.600 (362,660,635)	
イギリス・ポ ンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	21,578	16.835	363,265.630	
イギリス・ポンド	小計	21,578		363,265.630 (50,232,371)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	233,224	2,007.000	468,080,568.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	47,274	399.300	18,876,508.200	
	ASIAN PAINTS LTD	30,907	2,526.050	78,072,627.350	
	EICHER MOTORS LTD	9,713	2,492.650	24,211,109.450	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	22,335	909.500	20,313,682.500	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	65,338	736.150	48,098,568.700	
	SHREE CEMENT LTD	646	23,758.100	15,347,732.600	
	ICICI BANK LTD	429,749	506.950	217,861,255.550	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	61,815	215.550	13,324,223.250	
	STATE BANK OF INDIA LTD	155,751	269.550	41,982,682.050	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,379	402.250	4,174,952.750	
	TATA STEEL LTD	55,594	610.100	33,917,899.400	
	TATA MOTORS LTD	155,736	177.600	27,658,713.600	
	JSW STEEL LTD	60,652	362.300	21,974,219.600	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	48,959	579.900	28,391,324.100	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,437	3,739.750	31,552,270.750	
	NESTLE INDIA LTD	2,592	18,352.700	47,570,198.400	
GAIL INDIA LTD	131,540	120.050	15,791,377.000		

KOTAK MAHINDRA BANK LTD	44,644	1,903.300	84,970,925.200	
VEDANTA LTD	140,074	144.100	20,184,663.400	
AXIS BANK LTD	192,838	627.050	120,919,067.900	
TITAN COMPANY LTD	26,452	1,424.200	37,672,938.400	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	243,067	91.650	22,277,090.550	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	8,923	1,585.350	14,146,078.050	
LUPIN LTD	21,479	943.100	20,256,844.900	
ACC LTD	6,480	1,632.650	10,579,572.000	
BAJAJ FINANCE LTD	22,117	4,794.800	106,046,591.600	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	138,563	2,289.100	317,184,563.300	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	81,373	212.500	17,291,762.500	
INFOSYS LTD	278,818	1,167.750	325,589,719.500	
WIPRO LTD	97,668	355.900	34,760,041.200	
MRF LTD	153	77,615.200	11,875,125.600	
INDIAN OIL CORP LTD	189,644	92.450	17,532,587.800	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	69,060	2,350.450	162,322,077.000	
TRENT LTD	15,124	676.950	10,238,191.800	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	7,095	2,393.050	16,978,689.750	
HCL TECHNOLOGIES LTD	91,632	866.750	79,422,036.000	
DABUR INDIA LTD	48,710	514.400	25,056,424.000	
HERO MOTOCORP LTD	9,890	3,194.300	31,591,627.000	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,063	1,658.200	11,711,866.600	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,011	5,053.100	50,586,584.100	
IPCA LABORATORIES LTD	5,743	2,222.100	12,761,520.300	
BHARTI AIRTEL LTD	107,967	505.150	54,539,530.050	
UNITED SPIRITS LTD	28,072	593.000	16,646,696.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	74,317	565.200	42,003,968.400	
DIVI'S LABORATORIES LTD	10,580	3,732.250	39,487,205.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,096	7,736.000	85,838,656.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	20,977	899.000	18,858,323.000	
HAVELLS INDIA LTD	19,287	827.400	15,958,063.800	
INDRAPRASTHA GAS LTD	21,427	481.700	10,321,385.900	
BIOCON LTD	31,427	453.950	14,266,286.650	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	91,528	154.650	14,154,805.200	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	15,879	1,049.750	16,668,980.250	
PETRONET LNG LTD	50,647	254.900	12,909,920.300	
CIPLA LTD/INDIA	32,099	762.750	24,483,512.250	
LARSEN & TOUBRO LTD	50,352	1,190.350	59,936,503.200	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,836	4,964.300	48,828,854.800	

TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	75,288	2,784.300	209,624,378.400	
NTPC LTD	335,605	97.150	32,604,025.750	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,024	1,454.000	7,304,896.000	
YES BANK LTD	656,596	20.450	13,427,388.200	
AMBUJA CEMENTS LTD	53,675	248.300	13,327,502.500	
BHARAT FORGE LTD	15,849	539.200	8,545,780.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	126,711	242.700	30,752,759.700	
ITC LTD	258,174	212.700	54,913,609.800	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,329	1,651.350	20,359,494.150	
UNITED PHOSPHORUS LTD	44,677	438.450	19,588,630.650	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	5,000	2,651.700	13,258,500.000	
SIEMENS INDIA LTD	7,709	1,537.000	11,848,733.000	
INFO EDGE INDIA LTD	5,790	4,591.150	26,582,758.500	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	29,323	728.550	21,363,271.650	
TECH MAHINDRA LTD	50,121	927.300	46,477,203.300	
MARICO LTD	45,534	404.150	18,402,566.100	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	24,351.850	9,204,999.300	
DLF LTD	60,379	217.900	13,156,584.100	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	165,263	192.750	31,854,443.250	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	47,352	471.000	22,302,792.000	
REC LTD	43,697	131.950	5,765,819.150	
BAJAJ FINSERV LTD	3,437	9,028.850	31,032,157.450	
BAJAJ AUTO LTD	6,504	3,290.850	21,403,688.400	
JUBILANT FOODWORKS LTD	7,218	2,578.150	18,609,086.700	
MUTHOOT FINANCE LTD	9,841	1,184.700	11,658,632.700	
COAL INDIA LTD	99,458	134.850	13,411,911.300	
BHARTI INFRA TEL LTD	14,070	245.750	3,457,702.500	
PI INDUSTRIES LTD	6,738	2,317.100	15,612,619.800	
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	158.250	369,197.250	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,126	3,251.400	13,415,276.400	
ADANI GREEN ENERGY LTD	31,348	1,036.700	32,498,471.600	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	60,955	659.450	40,196,774.750	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,364	2,839.150	9,550,900.600	
BANDHAN BANK LTD	64,957	414.900	26,950,659.300	
BERGER PAINTS INDIA LTD	21,333	679.550	14,496,840.150	
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,389	2,622.050	35,106,627.450	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	15,064	1,449.750	21,839,034.000	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	24,802	496.550	12,315,433.100	

	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,500	1,736.350	14,758,975.000	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	35,097	856.050	30,044,786.850	
インド・ルピー	小計	6,339,761		4,191,454,104.100 (5,951,864,828)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	2,412,200	1,195.000	2,882,579,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	157,401	26,025.000	4,096,361,025.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,975.000	2,461,477,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	546,400	7,550.000	4,125,320,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,611,200	5,825.000	9,385,240,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,919,200	3,260.000	12,776,592,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	647,000	6,300.000	4,076,100,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	44,275.000	1,434,510,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	148,500	14,525.000	2,156,962,500.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	249,400	11,075.000	2,762,105,000.000	
	BANK MANDIRI	1,604,100	6,800.000	10,907,880,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,693,000	4,330.000	20,320,690,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	822,200	1,670.000	1,373,074,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	688,900	6,600.000	4,546,740,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,720,100	1,480.000	2,545,748,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	273,500	11,700.000	3,199,950,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	784,200	32,875.000	25,780,575,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,545.000	1,443,184,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	9,950.000	1,641,750,000.000	
	ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	304,300	1,680.000	511,224,000.000	
SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,459,800	1,010.000	1,474,398,000.000		
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	642,800	1,940.000	1,247,032,000.000		
インドネシア・ルピア	小計	24,168,601		121,149,492,525.000 (884,391,295)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	9,032	66.020	596,292.640	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,400	19.520	105,408.000	

ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	5,800	30.890	179,162.000	
BEIJING THUNISOFT CORP LTD	6,400	25.900	165,760.000	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	63.320	189,960.000	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	14.880	178,560.000	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	3,500	79.000	276,500.000	
UNISPLENDOR CORP LTD	29,340	21.400	627,876.000	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	9.870	160,881.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	14.900	284,590.000	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	44.120	176,480.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	139.090	166,908.000	
JOYOUNG CO LTD	5,100	32.450	165,495.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	23.880	179,100.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	1,600	378.000	604,800.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,530	22.200	233,766.000	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	21.290	140,514.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	12,200	67.510	823,622.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	20.460	120,714.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	28.710	548,361.000	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	5.080	120,904.000	
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	26.070	172,062.000	
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	18,150	35.110	637,246.500	
GEM CO LTD	29,100	5.140	149,574.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	34.030	234,807.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	7.720	143,592.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	13,800	56.380	778,044.000	

WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	6,120	37.840	231,580.800	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	40.560	239,466.240	
ZHEJIANG NHU CO LTD	18,200	33.330	606,606.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	1,900	24.480	46,512.000	
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	8,500	64.600	549,100.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	28.400	187,440.000	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINES CORP LTD	3,900	52.800	205,920.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	48.420	164,628.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	2,100	37.550	78,855.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	19.540	29,310.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	25,600	19.250	492,800.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	12,000	59.800	717,600.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	23.760	199,584.000	
VENUSTECH GROUP INC	1,000	28.700	28,700.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	16,700	75.000	1,252,500.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	6,400	142.300	910,720.000	
GLODON CO LTD	2,300	67.700	155,710.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	22.880	233,376.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	14.630	163,856.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	5.230	164,222.000	
NAVINFO CO LTD	34,300	15.370	527,191.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	7.270	103,961.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	16.340	44,608.200	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	20.470	53,222.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	42.270	329,706.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	25,900	25.280	654,752.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	26.120	156,720.000	

UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	113.080	361,856.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	28.100	100,317.000	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	16.920	252,108.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	11.480	145,796.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	14.830	127,538.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	50,000	3.680	184,000.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	18,280	68.450	1,251,266.000	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	13,900	34.450	478,855.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	28.950	199,755.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	5.500	210,100.000	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,300	41.100	53,430.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	42.050	206,045.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	11.440	175,032.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	9.640	202,440.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	28.670	215,025.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	35.900	179,500.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	28.440	187,704.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	6,600	190.700	1,258,620.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	7,400	84.150	622,710.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	9.150	136,792.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	9.630	170,451.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	17,800	23.700	421,860.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	18.020	107,038.800	

BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,800	33.520	127,376.000	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	7.050	112,800.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	139.090	292,089.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	5.490	200,275.200	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	12.510	178,893.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	38,054	51.800	1,971,197.200	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	7.810	214,775.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	100,400	10.480	1,052,192.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	24.460	486,754.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	29,400	21.010	617,694.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	9.040	34,352.000	
IFLYTEK CO LTD	19,300	38.000	733,400.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.260	236,622.000	
GOERTEK INC	21,600	39.200	846,720.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	8.700	185,310.000	
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	57,500	8.040	462,300.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,400	35.010	1,239,354.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	14,600	33.100	483,260.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	6.830	323,742.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	8.230	232,909.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	6.800	255,680.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	12,200	22.590	275,598.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	9.370	212,699.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	18,200	46.700	849,940.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	7,200	103.530	745,416.000	
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUSTRY GROUP	10,700	30.250	323,675.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	43,240	26.730	1,155,805.200	

JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	6,800	200.500	1,363,400.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	20,000	267.670	5,353,400.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	7.870	163,696.000	
SUNING.COM CO LTD	86,600	8.680	751,688.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	219,300	5.180	1,135,974.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	64,100	13.740	880,734.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	16,600	62.830	1,042,978.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	50,700	45.000	2,281,500.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	13.280	225,760.000	
PING AN BANK CO LTD	84,900	18.650	1,583,385.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	30,280	19.120	578,953.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	189,900	5.150	977,985.000	
CHINA VANKE CO LTD	47,900	28.580	1,368,982.000	
ZTE CORP	35,300	32.840	1,159,252.000	
ZOONLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	9.830	280,155.000	
WEICHAI POWER CO LTD	61,100	16.100	983,710.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	43.640	183,288.000	
GF SECURITIES CO LTD	62,300	16.150	1,006,145.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	11.990	252,989.000	
BYD CO LTD	8,400	169.520	1,423,968.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	14.120	481,492.000	
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	11,000	33.680	370,480.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	15.740	203,046.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	58.840	170,636.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	23.000	184,000.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,200	168.700	202,440.000	
JIANGXI ZHENGBO TECHNOLOGY CO LTD	3,600	17.600	63,360.000	

HUNAN VALIN STEEL CO LTD	49,400	5.200	256,880.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	27.000	149,850.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	229.610	275,532.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	12.420	193,752.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	29.650	195,690.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	71.450	42,870.000	
NINESTAR CORP	5,700	29.940	170,658.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	17.470	122,639.400	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	4.060	137,228.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	17.280	207,360.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	4,200	64.700	271,740.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	96.960	155,136.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	277.530	138,765.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	12.300	185,730.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	21.000	111,300.000	
SF HOLDING CO LTD	17,200	78.940	1,357,768.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	10.120	238,832.000	
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	6,500	42.670	277,355.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	107,990	7.980	861,760.200	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	49,300	16.760	826,268.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	43.000	584,800.000	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	5,000	60.890	304,450.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,100	100.070	210,147.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	39,400	24.540	966,876.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	72.600	225,060.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	15.170	341,325.000	

CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	44.830	233,116.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	72.200	227,430.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	109.500	361,350.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	108.510	292,977.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	73.890	229,059.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	125.280	263,088.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	7.190	169,684.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	56.240	242,956.800	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	17.030	161,785.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	51.950	155,850.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	21.140	164,892.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	106.890	89,787.600	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	67.900	183,330.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	1,600	74.250	118,800.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	69.250	92,102.500	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	130.280	169,364.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	79.900	239,700.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	4,700	150.210	705,987.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	12.690	161,163.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	11.080	299,160.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	100.200	190,380.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	12.560	123,088.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	13.430	193,392.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,300	351.530	1,511,579.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	38.480	203,944.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	11.930	184,915.000	

SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,100	210.000	231,000.000	
OVCTEK CHINA INC	2,900	76.060	220,574.000	
SG MICRO CORP	600	282.000	169,200.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	12,400	264.820	3,283,768.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	2,440	209.900	512,156.000	
WUXI APPTec CO LTD	11,660	109.660	1,278,635.600	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	8,400	104.590	878,556.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	1,000	558.000	558,000.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,700	232.410	859,917.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	2.270	185,459.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	166.160	149,544.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	60,900	5.700	347,130.000	
PETROCHINA CO LTD	110,900	4.190	464,671.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	5.060	1,071,708.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	3.230	886,312.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.220	270,480.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.060	170,926.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	40.530	405,300.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	15,500	18.540	287,370.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	108,200	44.280	4,791,096.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	58,500	87.680	5,129,280.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	87,800	20.280	1,780,584.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	118,800	9.820	1,166,616.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	5.300	732,460.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	46,600	23.760	1,107,216.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,300	1,832.900	11,547,270.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	137,200	4.580	628,376.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	71,900	29.160	2,096,604.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,700	37.350	1,520,145.000	

SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	4.470	171,201.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	88,100	19.950	1,757,595.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	97,700	6.810	665,337.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	141,600	4.060	574,896.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	200,300	5.140	1,029,542.000	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	210,500	4.200	884,100.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	66,100	12.750	842,775.000	
HUAXIA BANK CO LTD	112,900	6.310	712,399.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	28,300	39.430	1,115,869.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	166,300	4.950	823,185.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	185,100	4.700	869,970.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	145,400	6.160	895,664.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	21,900	52.910	1,158,729.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	22.730	761,455.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	4.740	36,972.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	73,200	16.210	1,186,572.000	
CRRC CORP LTD	181,300	5.490	995,337.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	28,160	89.000	2,506,240.000	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	49,000	12.450	610,050.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	118,900	8.300	986,870.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	46,100	18.590	856,999.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	21,000	7.580	159,180.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	171,600	5.460	936,936.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	18,200	59.680	1,086,176.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	37,900	26.200	992,980.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	39,300	30.850	1,212,405.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	18,100	6.580	119,098.000	

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,300	54.840	893,892.000	
GEMDALE CORP	10,600	14.080	149,248.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	22,100	27.350	604,435.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	14,000	82.120	1,149,680.000	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	12,870	14.070	181,080.900	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	162,200	8.550	1,386,810.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	58,000	8.820	511,560.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	8.600	271,760.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	37,400	22.440	839,256.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.420	131,716.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	8,400	207.800	1,745,520.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	694,200	1.190	826,098.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	5,600	98.680	552,608.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	166,900	4.340	724,346.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	210,400	3.800	799,520.000	
AIR CHINA LTD	28,400	7.720	219,248.000	
TBEA CO LTD	26,700	8.150	217,605.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	31,400	5.930	186,202.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	277,400	2.640	732,336.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	169,400	3.970	672,518.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	75.000	247,500.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	30.500	210,450.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	5.150	176,645.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,400	29.370	246,708.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	16.770	248,196.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	14.070	67,536.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	9.890	234,393.000	

SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	27,500	19.480	535,700.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	45.050	418,965.000	
BANK OF NANJING CO LTD	89,700	8.040	721,188.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	17.330	131,708.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	183,300	4.380	802,854.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	32,700	9.040	295,608.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	8.360	235,752.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	23.700	225,624.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	32.370	246,012.000	
BBMG CORP	54,200	3.040	164,768.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	7.260	213,444.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	10.910	202,926.000	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO LTD	12,500	16.940	211,750.000	
LIAONING CHENG DA CO LTD	1,600	24.420	39,072.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	10.190	153,043.610	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	101,500	6.470	656,705.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	5,640	102.590	578,607.600	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	44.630	725,237.500	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.080	198,816.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	3.040	179,360.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.080	171,612.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	7.160	183,296.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	51.550	237,130.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	9.660	162,288.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.990	196,606.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.790	133,084.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,100	245.870	762,197.000	

TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	13.440	120,960.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	26,600	5.370	142,842.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	4,000	279.580	1,118,320.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	23.580	28,296.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	26,300	5.730	150,699.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	8.830	220,750.000	
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	25,900	6.570	170,163.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	3,100	73.940	229,214.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	7.390	167,014.000	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	39.870	215,298.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	12,900	7.160	92,364.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	10.690	134,694.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	6.530	195,900.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	68.230	286,566.000	
INNER MONGOLIA FIRST MACHINERY GROUP CO LTD	19,900	9.810	195,219.000	
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD	6,400	22.360	143,104.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	33.990	198,161.700	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,900	14.350	170,765.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	14.630	172,634.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	27.960	125,820.000	
TONGWEI CO LTD	28,100	30.900	868,290.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,100	64.100	70,510.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	117.740	294,350.000	

SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	51.370	272,261.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	23.590	132,104.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	9,300	34.640	322,152.000	
CHINA JUSHI CO LTD	23,400	16.680	390,312.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	9,124	98.430	898,075.320	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	47,000	14.480	680,560.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	19.000	298,300.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	119.790	203,643.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	48.760	238,924.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	16,900	74.100	1,252,290.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	187.320	337,176.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,800	21.820	148,376.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	10.040	324,804.040	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	14,180	190.210	2,697,177.800	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	51.650	258,250.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	23.590	28,308.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	49.910	289,478.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	12.400	163,680.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	50,600	18.010	911,306.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	4.670	278,799.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	66.380	225,692.000	
HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	7.920	130,680.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	117,300	5.930	695,589.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	14.330	338,188.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	9,000	32.560	293,040.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,100	149.670	164,637.000	

	SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	25.960	51,920.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	158.690	190,428.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	12.300	482,160.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	43,300	14.050	608,365.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	500	243.190	121,595.000	
	TOLY BREAD CO LTD	3,600	60.470	217,692.000	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,200	96.500	212,300.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	103.850	305,319.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	69,300	11.030	764,379.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	12,500	50.720	634,000.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	18.320	293,120.000	
	DAWNING INFORMATION INDUSTRY CO LTD	4,100	32.950	135,095.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,300	82.860	522,018.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	29,200	6.350	185,420.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	3,700	35.100	129,870.000	
オフショア・人民元 小計		11,565,684		190,269,263.450 (3,030,989,367)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	372,921	18.090	6,746,140.890	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	132,693	4.250	563,945.250	
	OOREDOO QSC	68,912	7.100	489,275.200	
	QATAR FUEL QSC	48,014	18.700	897,861.800	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	38,453	18.360	705,997.080	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	9.030	460,782.840	
	INDUSTRIES QATAR QSC	163,176	10.640	1,736,192.640	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	98,974	17.000	1,682,558.000	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	141,030	3.260	459,757.800	
	MASRAF AL RAYAN	321,573	4.445	1,429,391.980	
	BARWA REAL ESTATE CO	210,374	3.426	720,741.320	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	315,368	2.060	649,658.080	
カタール・リアル 小計		1,962,516		16,542,302.880 (468,974,287)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	336,619	0.678	228,227.680	

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	160,726	0.608	97,721.400	
	GULF BANK KSCP	142,660	0.218	31,099.880	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	514,747	0.846	435,475.960	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	99,414	0.678	67,402.690	
	MABANEE CO KPSC	50,277	0.671	33,735.860	
	BOUBYAN BANK KSCP	73,893	0.573	42,340.680	
	クウェート・ディナール 小計	1,378,336		936,004.150 (319,402,056)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	33,828	24,010.000	812,210,280.000	
	ECOPETROL SA	267,551	2,305.000	616,705,055.000	
	BANCOLOMBIA SA	24,862	31,720.000	788,622,640.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	41,061	32,500.000	1,334,482,500.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	22,820	24,100.000	549,962,000.000	
	コロンビア・ペソ 小計	390,122		4,101,982,475.000 (124,700,267)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	24,558	61.800	1,517,684.400	
	JARIR MARKETING CO	4,471	173.600	776,165.600	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	80.000	332,400.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	27,620	29.100	803,742.000	
	SAUDI BRITISH BANK	64,702	25.000	1,617,550.000	
	AL RAJHI BANK	101,442	73.600	7,466,131.200	
	ARAB NATIONAL BANK	43,653	20.120	878,298.360	
	BANK ALBILAD	28,593	27.200	777,729.600	
	BANK AL-JAZIRA	35,440	13.800	489,072.000	
	BANQUE SAUDI FRANSI	52,495	32.000	1,679,840.000	
	RIYAD BANK	116,167	20.300	2,358,190.100	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	85,091	30.100	2,561,239.100	
	SAUDI TELECOM CO	50,163	105.800	5,307,245.400	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	18,151	82.000	1,488,382.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	71,654	97.000	6,950,438.000	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	58.300	377,609.100	
	SAUDI ELECTRICITY CO	74,750	21.480	1,605,630.000	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	15,467	27.600	426,889.200	
	SAVOLA GROUP	18,780	42.750	802,845.000	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	13.800	310,886.400	
	ALMARAI CO JSC	23,092	54.700	1,263,132.400	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	9.620	272,351.820	

	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	31,742	17.140	544,057.880	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	11,829	61.900	732,215.100	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	58,284	13.420	782,171.280	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	29,487	8.840	260,665.080	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	10,717	14.500	155,396.500	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	28,039	13.580	380,769.620	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,116	121.200	741,259.200	
	ALINMA BANK	87,910	16.480	1,448,756.800	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	2,636	121.400	320,010.400	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	32,160	41.900	1,347,504.000	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	3,088	78.700	243,025.600	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	182,063	35.500	6,463,236.500	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	2,754	109.600	301,838.400	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	116,633	42.450	4,951,070.850	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,521,218		58,735,428.890 (1,631,670,215)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	37,300	133.000	4,960,900.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	77,800	38.000	2,956,400.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	404,800	11.900	4,817,120.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	83,400	56.750	4,732,950.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	68,000	91.500	6,222,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,324,055	3.400	4,501,787.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	44,200	121.500	5,370,300.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	25,500	212.000	5,406,000.000	
	SHIN CORP PCL	201,700	56.500	11,396,050.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	280,400	28.500	7,991,400.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	100,900	189.000	19,070,100.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	562,920	14.500	8,162,340.000	

DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	24,300	343.000	8,334,900.000	
PTT PCL	903,300	43.000	38,841,900.000	
THAI UNION GROUP PCL- NVDR	320,300	14.700	4,708,410.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	65,600	53.500	3,509,600.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	808,900	8.500	6,875,650.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	66,550	395.000	26,287,250.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	367,600	68.000	24,996,800.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	113,100	121.000	13,685,100.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	173,500	56.250	9,759,375.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	737,200	22.100	16,292,120.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	126.500	3,832,950.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	207,910	28.000	5,821,480.000	
THAI OIL PCL NVDR	121,100	55.500	6,721,050.000	
CP ALL PCL NVDR	442,700	61.750	27,336,725.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	791,900	10.400	8,235,760.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	99,345	103.000	10,232,535.000	
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	29,200	38.000	1,109,600.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	123,422	35.250	4,350,625.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	165,508	59.750	9,889,103.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	138,400	48.250	6,677,800.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	613,600	9.200	5,645,120.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	52.250	2,957,350.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	207,700	36.000	7,477,200.000	
OSOTSPA PCL NVDR	96,600	39.750	3,839,850.000	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	21.900	2,306,070.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	455,600	5.000	2,278,000.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	165,233	35.000	5,783,155.000	
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	56,800	61.500	3,493,200.000	

	SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	31,100	71.750	2,231,425.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	55.750	3,406,325.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	71.500	3,510,650.000	
タイ・パーツ 小計		10,839,843		366,014,425.500 (1,266,409,912)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,964	630.000	3,127,320.000	
	CEZ	13,979	470.000	6,570,130.000	
	MONETA MONEY BANK AS	51,527	66.200	3,411,087.400	
チェコ・コルナ 小計		70,470		13,108,537.400 (62,920,980)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,676,246	35.400	200,939,108.400	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,875	27,600.000	134,550,000.000	
	BANCO DE CHILE	3,588,385	73.010	261,987,988.850	
	EMPRESAS CMPC SA	99,224	1,720.000	170,665,280.000	
	EMPRESAS COPEC SA	30,491	6,512.500	198,572,637.500	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,581	5,616.000	59,422,896.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,942,250	114.690	337,446,652.500	
	COLBUN SA	580,423	124.650	72,349,726.950	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	20,026	1,750.000	35,045,500.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,561	34,280.000	327,751,080.000	
	FALABELLA SA	71,676	2,506.000	179,620,056.000	
	CENCOSUD SA	93,545	1,295.000	121,140,775.000	
	CENCOSUD SHOPPING SA	29,231	1,242.300	36,313,671.300	
	ENEL CHILE SA	2,756,140	54.700	150,760,858.000	
チリ・ペソ 小計		15,912,654		2,286,566,230.500 (323,320,465)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	209,652	6.260	1,312,421.520	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	17.630	791,551.740	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	134,255	13.420	1,801,702.100	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	123.900	578,365.200	
	KOC HOLDING AS	53,770	18.800	1,010,876.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	7.160	644,400.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,206	12.210	539,755.260	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	89,787	15.320	1,375,536.840	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	209,164	9.500	1,987,058.000	
	TURKIYE IS BANKASI	161,663	6.520	1,054,042.760	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	14,186	97.650	1,385,262.900	

	YAPI VE KREDI BANKASI AS	239,230	2.940	703,336.200	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	104,770	10.450	1,094,846.500	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	33,169	69.050	2,290,319.450	
トルコ・リラ 小計		1,433,418		16,569,474.470 (218,385,674)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	10,285	7,580.000	77,960,300.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	30,703	2,106.000	64,660,518.000	
	OTP BANK NYRT	18,961	12,960.000	245,734,560.000	
ハンガリー・フォリント 小計		59,949		388,355,378.000 (138,604,034)	
パキスタン・ ルピー	MCB BANK LTD	12,400	181.970	2,256,428.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	21,868	101.830	2,226,818.440	
	HABIB BANK LTD	19,300	132.320	2,553,776.000	
パキスタン・ルピー 小計		53,568		7,037,022.440 (4,574,065)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	713,900	40.050	28,591,695.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	134,530	45.950	6,181,653.500	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	117,170	83.000	9,725,110.000	
	AYALA CORP	25,073	840.000	21,061,320.000	
	GLOBE TELECOM INC	3,330	2,042.000	6,799,860.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	95,990	123.200	11,825,968.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	269,770	68.550	18,492,733.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	32,590	207.800	6,772,202.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	148,275	50.400	7,473,060.000	
	BDO UNIBANK INC	157,283	108.300	17,033,748.900	
	MEGAWORLD CORP	879,000	3.940	3,463,260.000	
	PLDT INC	5,550	1,330.000	7,381,500.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	864,975	38.400	33,215,040.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,430	148.000	9,387,640.000	
	SM INVESTMENTS CORP	20,738	1,050.000	21,774,900.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	4.330	3,905,227.000	
	ABOITIZ POWER CORP	95,700	27.350	2,617,395.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	295.400	5,231,534.000	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	67,600	42.450	2,869,620.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	656.500	4,333,556.500	
フィリピン・ペソ 小計		4,621,115		228,137,023.400 (492,775,971)	

ブラジル・レアル	BRF SA	53,392	22.110	1,180,497.120	
	VALE SA	300,121	85.000	25,510,285.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	7,900	69.650	550,235.000	
	RAIA DROGASIL SA	94,000	24.590	2,311,460.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	30,750	36.890	1,134,367.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	36.620	721,414.000	
	BANCO DO BRASIL SA	61,200	37.830	2,315,196.000	
	ITAUSA SA	336,960	11.500	3,875,040.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	65,274	24.980	1,630,544.520	
	GERDAU SA	76,130	23.000	1,750,990.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	15,406	71.690	1,104,456.140	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	287,910	28.250	8,133,457.500	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	60,600	21.390	1,296,234.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	396,012	27.820	11,017,053.840	
	CCR SA	93,220	13.620	1,269,656.400	
	WEG SA	71,072	71.000	5,046,112.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	381,585	26.790	10,222,662.150	
	BANCO BRADESCO SA	87,225	23.720	2,068,977.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,006	28.530	1,797,561.180	
	BRADSPAR SA	13,400	64.280	861,352.000	
	SUZANO SA	64,675	50.550	3,269,321.250	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	30.810	520,689.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	385,747	31.550	12,170,317.850	
	B2W CIA DIGITAL	19,700	81.500	1,605,550.000	
	ENGIE BRASIL SA	14,887	43.320	644,904.840	
	ALPARGATAS SA	9,600	40.170	385,632.000	
	LOCALIZA RENT A CAR	51,989	63.530	3,302,861.170	
	LOJAS RENNER SA	69,437	43.810	3,042,034.970	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	57,104	22.880	1,306,539.520	
	COSAN SA	10,700	71.350	763,445.000	
	TOTVS SA	27,900	26.080	727,632.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	70,200	21.670	1,521,234.000	
JBS SA	95,300	22.280	2,123,284.000		
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	93,069	13.240	1,232,233.560		
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	30,198	46.110	1,392,429.780		

MULTIPLAN EMPREENHIMENTOS IMOBILIARIOS SA	29,940	25.950	776,943.000	
HYPERA SA	25,400	32.150	816,610.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	163,316	58.210	9,506,624.360	
MAGAZINE LUIZA SA	246,500	23.400	5,768,100.000	
TELEFONICA BRASIL SA	33,428	45.530	1,521,976.840	
VIA VAREJO S/A	110,800	17.020	1,885,816.000	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	50,100	29.470	1,476,447.000	
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	41,800	75.050	3,137,090.000	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	99,000	15.260	1,510,740.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	19.100	571,090.000	
AMBEV SA	402,695	15.690	6,318,284.550	
NATURA &CO HOLDING SA	76,400	47.910	3,660,324.000	
TIM SA	62,200	14.220	884,484.000	
RUMO SA	115,000	19.300	2,219,500.000	
ブラジル・リアル 小計	5,018,748		157,859,690.040 (3,270,852,778)	
ポーランド・ ズロチ				
KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,488	189.350	1,985,902.800	
BANK PEKAO SA	17,097	61.800	1,056,594.600	
ORANGE POLSKA SA	70,386	6.400	450,470.400	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	23,203	61.980	1,438,121.940	
LPP SA	87	7,065.000	614,655.000	
SANTANDER BANK POLSKA SA	3,761	189.200	711,581.200	
CD PROJEKT RED SA	5,865	362.000	2,123,130.000	
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	64,117	28.660	1,837,593.220	
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	168,334	5.448	917,083.630	
CYFROWY POLSAT SA	29,131	27.340	796,441.540	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	6.662	347,703.100	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	45,253	29.070	1,315,504.710	
DINO POLSKA SA	4,364	260.000	1,134,640.000	
ALLEGRO.EU SA	22,170	78.700	1,744,779.000	
ポーランド・ズロチ 小計	516,448		16,474,201.140 (470,008,959)	

マレーシア・ リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	97,600	3.500	341,600.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,100	9.860	139,026.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	487,800	4.280	2,087,784.000	
	DIGI.COM BHD	235,600	4.130	973,028.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	68,520	5.750	393,990.000	
	RHB BANK BHD	137,280	5.850	803,088.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	34,400	8.250	283,800.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	406,500	6.990	2,841,435.000	
	GAMUDA BHD	178,800	3.870	691,956.000	
	GENTING BHD	201,000	4.480	900,480.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	8,756	18.000	157,608.000	
	HONG LEONG BANK BHD	57,908	18.900	1,094,461.200	
	IOI CORP BHD	235,813	4.450	1,049,367.850	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	34,200	23.660	809,172.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	32.460	376,536.000	
	MALAYAN BANKING BHD	317,675	8.380	2,662,116.500	
	MISC BHD	100,880	6.820	688,001.600	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,000	137.300	823,800.000	
	PPB GROUP BHD	59,160	18.740	1,108,658.400	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	20.380	454,474.000	
	PETRONAS GAS BHD	73,100	17.260	1,261,706.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	307,400	2.610	802,314.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	56,700	5.240	297,108.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	198,950	10.500	2,088,975.000	
	QL RESOURCES BHD	96,650	6.030	582,799.500	
	DIALOG GROUP BHD	375,944	3.530	1,327,082.320	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	247,930	20.200	5,008,186.000	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	82,800	5.820	481,896.000	
	SUPERMAX CORP BHD	136,671	7.770	1,061,933.670	
	SIME DARBY BERHAD	297,100	2.320	689,272.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	147,800	14.360	2,122,408.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	270,100	3.740	1,010,174.000	
	MAXIS BHD	209,000	5.020	1,049,180.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	173,200	7.660	1,326,712.000		
IHH HEALTHCARE BHD	168,700	5.570	939,659.000		
WESTPORTS HOLDINGS BHD	42,000	4.400	184,800.000		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	94,300	8.050	759,115.000		
SIME DARBY PLANTATION BHD	135,100	5.060	683,606.000		
マレーシア・リンギット 小計	5,829,337		40,357,309.040 (1,035,568,550)		

メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	281,700	16.640	4,687,488.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	143,800	42.040	6,045,352.000	
	GRUMA SAB DE CV	17,065	222.400	3,795,256.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	16,460	177.250	2,917,535.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	51.330	1,791,417.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	210,200	112.740	23,697,948.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	103,225	45.270	4,672,995.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,925	330.570	4,603,187.250	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	116,900	33.000	3,857,700.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	15,875	315.770	5,012,848.750	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	262,752	78.180	20,541,951.360	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,697,678	14.100	38,037,259.800	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	223,900	19.940	4,464,566.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	29,200	103.640	3,026,288.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	437,900	55.500	24,303,450.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	26,940	218.100	5,875,614.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	52,600	79.120	4,161,712.000	
	TELESITES SAB DE CV	77,300	21.800	1,685,140.000	
BECLE SAB DE CV	38,400	47.930	1,840,512.000		
メキシコ・ペソ	小計	4,800,720		165,018,220.910 (858,094,749)	
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,446	13.500	276,021.000	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	OPAP SA	18,694	10.350	193,482.900	
	JUMBO SA	7,156	14.490	103,690.440	
ユーロ	小計	49,426		573,194.340 (72,388,713)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,300	20,700.000	151,110,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PFD	2,222	90,100.000	200,202,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,711	187,000.000	506,957,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,843	44,100.000	169,476,300.000	
	COWAY CO LTD	4,363	70,000.000	305,410,000.000	
	KT&G CORP	9,391	86,100.000	808,565,100.000	
	S-1 CORPORATION	1,888	80,500.000	151,984,000.000	

KOREA GAS CORP	802	29,350.000	23,538,700.000	
CJ CORP	1,001	82,000.000	82,082,000.000	
KAKAO CORP	4,808	370,500.000	1,781,364,000.000	
CJ ENM CO LTD	563	137,300.000	77,299,900.000	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,497	27,950.000	69,791,150.000	
KMW CO LTD	1,651	78,000.000	128,778,000.000	
SK TELECOM CO LTD	3,387	238,000.000	806,106,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,607	83,500.000	217,684,500.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	27,482	10,000.000	274,820,000.000	
NCSOFT CORPORATION	1,410	878,000.000	1,237,980,000.000	
LG UPLUS CORP	20,172	11,600.000	233,995,200.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	15,261	14,600.000	222,810,600.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	782	1,531,000.000	1,197,242,000.000	
LG CHEM LTD	3,790	817,000.000	3,096,430,000.000	
LG CHEM LTD	527	382,500.000	201,577,500.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	78	697,000.000	54,366,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	34,799	34,250.000	1,191,865,750.000	
S-OIL CORP	3,627	72,000.000	261,144,000.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	9,102	46,200.000	420,512,400.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	3,800.000	76,957,600.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,263	41,400.000	217,888,200.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	1,403	106,000.000	148,718,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,524	277,500.000	422,910,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,961	84,500.000	250,204,500.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,020	102,500.000	309,550,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,349	243,500.000	1,302,481,500.000	
SK HYNIX INC	44,054	116,500.000	5,132,291,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,024	38,350.000	269,370,400.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	87,100.000	131,956,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	12,563	191,500.000	2,405,814,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,762	40,600.000	315,137,200.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,114	9,420.000	198,893,880.000	
KIA MOTORS CORP	22,347	63,800.000	1,425,738,600.000	
KOREA ZINC CO LTD	629	389,500.000	244,995,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,657	23,800.000	539,236,600.000	

HANWHA CORP	2,418	25,800.000	62,384,400.000	
KOREAN AIR CO LTD	4,343	28,300.000	122,906,900.000	
CJ LOGISTICS	958	161,500.000	154,717,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,197	139,000.000	166,383,000.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,811	100,500.000	182,005,500.000	
HLB INC	3,880	98,500.000	382,180,000.000	
LG ELECTRONICS INC	9,055	95,400.000	863,847,000.000	
LOTTE CORP	1,591	34,500.000	54,889,500.000	
LG CORP	7,302	75,800.000	553,491,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	11,850.000	108,581,550.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,627	38,150.000	138,370,050.000	
NAVER CORP	9,999	286,000.000	2,859,714,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,804	78,000.000	296,712,000.000	
OTTOGI CORP	198	552,000.000	109,296,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,001	57,800.000	115,657,800.000	
KANGWON LAND INC	8,713	23,700.000	206,498,100.000	
POSCO	5,900	272,000.000	1,604,800,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	15,393	13,700.000	210,884,100.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,441	560,000.000	2,486,960,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,841	164,000.000	793,924,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	389,617	72,900.000	28,403,079,300.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	36,740	6,970.000	256,077,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	66,419	67,800.000	4,503,208,200.000	
SHINSEGAE CO LTD	513	243,000.000	124,659,000.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,568	190,500.000	489,204,000.000	
YUHAN CORP	3,718	66,100.000	245,759,800.000	
HANON SYSTEMS	17,912	15,750.000	282,114,000.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,564	22,600.000	148,346,400.000	
GS HOLDINGS CORP	4,870	37,650.000	183,355,500.000	
LG DISPLAY CO LTD	17,034	16,650.000	283,616,100.000	
CELLTRION INC	7,680	360,000.000	2,764,800,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	23,660	35,500.000	839,930,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,360	184,000.000	250,240,000.000	
CELLTRION PHARM INC	876	225,500.000	197,538,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	550	103,000.000	56,650,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,027	72,700.000	365,462,900.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,918	214,000.000	624,452,000.000	
SAMSUNG CARD CO	3,026	34,250.000	103,640,500.000	

	SK INNOVATION CO LTD	4,754	190,500.000	905,637,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	621	364,000.000	226,044,000.000	
	STX PAN OCEAN CO LTD	13,510	4,190.000	56,606,900.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,366	169,000.000	230,854,000.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,033	243,000.000	737,019,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	31,465	46,400.000	1,459,976,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	8,190	24,000.000	196,560,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	478	352,000.000	168,256,000.000	
	FILA HOLDINGS CORP	4,492	42,200.000	189,562,400.000	
	SEEGENE INC	1,621	196,800.000	319,012,800.000	
	E-MART CO LTD	1,464	154,500.000	226,188,000.000	
	GS RETAIL CO LTD	1,288	34,100.000	43,920,800.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,062	38,600.000	272,593,200.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	664	279,500.000	185,588,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	786	128,000.000	100,608,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,835	121,500.000	222,952,500.000	
	SK CHEMICALS CO LTD	621	387,500.000	240,637,500.000	
	NETMARBLE CORP	1,353	128,000.000	173,184,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	47,659	10,050.000	478,972,950.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,169	178,500.000	208,666,500.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,002	175,000.000	525,350,000.000	
	ALTEOGEN INC	1,622	172,800.000	280,281,600.000	
	SAMSUNG C&T CORP	7,236	125,000.000	904,500,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,413	819,000.000	1,157,247,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	314	241,200.000	75,736,800.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,922	30,400.000	88,828,800.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,960	156,900.000	935,124,000.000	
	韓国・ウォン 小計	1,193,088		89,471,480,030.000 (8,580,314,935)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	134,000	12.400	1,661,600.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	8.510	765,900.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	4.850	785,700.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	5,700	92.750	528,675.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	496,500	44.950	22,317,675.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	100,500	48.100	4,834,050.000	
	BEIJING ENTERPRISES	54,000	24.850	1,341,900.000	

HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	206,000	2.750	566,500.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	318,000	25.400	8,077,200.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	172,000	6.290	1,081,880.000	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	46,000	19.280	886,880.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	60,500	52.800	3,194,400.000	
CNOOC LTD	1,447,000	6.550	9,477,850.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	232,000	6.070	1,408,240.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	769,600	7.280	5,602,688.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	323,120	17.500	5,654,600.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	254,888	32.250	8,220,138.000	
CITIC LTD	443,000	5.570	2,467,510.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	198,000	6.670	1,320,660.000	
LENOVO GROUP LTD	548,000	5.820	3,189,360.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,798,000	2.320	4,171,360.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	442,742	4.380	1,939,209.960	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	130,390	14.100	1,838,499.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,113,200	3.320	7,015,824.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	87,000	18.800	1,635,600.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	203,000	25.450	5,166,350.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	61,600	105.100	6,474,160.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	358,000	5.750	2,058,500.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	96,000	5.140	493,440.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	804,000	1.560	1,254,240.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	152,000	9.270	1,409,040.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	2.780	405,880.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	135,000	19.440	2,624,400.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	67,500	12.680	855,900.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	108,000	10.300	1,112,400.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	223,800	29.000	6,490,200.000	

KINGBOARD HOLDINGS LTD	52,000	29.650	1,541,800.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	482,000	21.200	10,218,400.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	216,000	2.560	552,960.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	82,000	38.950	3,193,900.000	
BYD CO LTD	55,000	175.100	9,630,500.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,146,000	2.150	2,463,900.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	5.630	664,340.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,070,000	0.960	1,027,200.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	236,592	4.450	1,052,834.400	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	6.100	427,000.000	
CHINA YOUZAN LTD	1,116,000	2.200	2,455,200.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	529,788	6.020	3,189,323.760	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	153,000	4.400	673,200.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	157,200	7.690	1,208,868.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	270,000	15.080	4,071,600.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	605,000	17.260	10,442,300.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	407,000	7.310	2,975,170.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	220,000	14.000	3,080,000.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	326,700	22.250	7,269,075.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	139,440	15.320	2,136,220.800	
TINGYI HOLDING CORP	178,000	13.400	2,385,200.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	38,000	77.000	2,926,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	262,000	12.280	3,217,360.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	334,000	3.620	1,209,080.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	117,333	64.450	7,562,111.850	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	86,000	6.060	521,160.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	892,250	6.810	6,076,222.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	220,000	41.900	9,218,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	469,300	578.000	271,255,400.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	479,000	94.550	45,289,450.000	

LI NING CO LTD	178,500	44.950	8,023,575.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	478,000	3.090	1,477,020.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	435,240	0.870	378,658.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	628,000	1.530	960,840.000	
AIR CHINA / HONG KONG	188,000	6.450	1,212,600.000	
ZTE CORP	44,288	18.980	840,586.240	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	295,500	14.580	4,308,390.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	285,500	7.190	2,052,745.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	754,205	4.110	3,099,782.550	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	102,250	4.710	481,597.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	66,000	41.050	2,709,300.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,819,530	5.810	45,431,469.300	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	69,700	139.000	9,688,300.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	250,000	7.660	1,915,000.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	98,000	10.260	1,005,480.000	
MINTH GROUP LTD	56,000	36.250	2,030,000.000	
SSY GROUP LTD	132,000	4.640	612,480.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	123,000	10.380	1,276,740.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	338,000	9.470	3,200,860.000	
BANK OF CHINA LTD	6,317,200	2.650	16,740,580.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	108,500	24.050	2,609,425.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	12.080	724,800.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	164,000	10.040	1,646,560.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	309,470	47.950	14,839,086.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	4,936,235	4.740	23,397,753.900	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	53,500	9.430	504,505.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	105,500	11.560	1,219,580.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.680	616,768.000	

CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	281,000	3.760	1,056,560.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	23.850	1,526,400.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	53,700	24.950	1,339,815.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	110,000	37.350	4,108,500.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	578,142	10.020	5,792,982.840	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	240,000	3.660	878,400.000	
CHINA CITIC BANK-H	633,800	3.270	2,072,526.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	124,500	9.830	1,223,835.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	57,200	148.400	8,488,480.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	91,000	110.200	10,028,200.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	20.200	404,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	193,028	10.980	2,119,447.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	526,000	3.650	1,919,900.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	7.390	628,150.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	308,000	3.310	1,019,480.000	
KINGSOFT CORP LTD	73,000	41.050	2,996,650.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	44,000	19.000	836,000.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	318,000	3.490	1,109,820.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	148,000	7.570	1,120,360.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	48,500	37.300	1,809,050.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	108,000	4.740	511,920.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	373,000	5.440	2,029,120.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	227,200	29.000	6,588,800.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	134,000	15.400	2,063,600.000	
CRRC CORP LTD - H	254,450	2.890	735,360.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	141,000	8.000	1,128,000.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	226,000	8.080	1,826,080.000	
SINOPHARM GROUP CO	124,800	19.020	2,373,696.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	176,000	9.230	1,624,480.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	212,527	7.800	1,657,710.600	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	177,000	7.090	1,254,930.000	

CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	198,000	3.150	623,700.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	294,000	6.100	1,793,400.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	64,200	12.500	802,500.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	196,000	27.300	5,350,800.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	136,200	9.000	1,225,800.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	150,500	43.400	6,531,700.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	60,300	31.400	1,893,420.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	398,156	4.310	1,716,052.360	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	126,000	3.790	477,540.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	74,000	12.040	890,960.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	70,000	12.680	887,600.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.940	735,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,316,000	2.840	6,577,440.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	49,500	53.300	2,638,350.000	
FAR EAST HORIZON LTD	166,000	8.120	1,347,920.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	58,000	35.100	2,035,800.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	147,500	16.900	2,492,750.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	206,000	6.420	1,322,520.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	156,800	6.530	1,023,904.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	818,000	2.430	1,987,740.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	39,000	34.850	1,359,150.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	258,000	6.030	1,555,740.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	211,000	4.660	983,260.000	
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	140,000	9.140	1,279,600.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	892,000	4.260	3,799,920.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	41,000	92.150	3,778,150.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	78,000	11.780	918,840.000	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	12,500	26.850	335,625.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	117,000	49.700	5,814,900.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	4.650	427,800.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	44,800	88.750	3,976,000.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	14.100	733,200.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	17.100	641,250.000	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	20,000	12.200	244,000.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	39,750	30.100	1,196,475.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,854,000	1.170	4,509,180.000	
XIAOMI CORP	1,001,000	27.600	27,627,600.000	
WUXI APPTec CO LTD	22,960	123.900	2,844,744.000	
MEITUAN	294,200	287.000	84,435,400.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	81,600	14.480	1,181,568.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	69,000	57.000	3,933,000.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	352,000	13.340	4,695,680.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	82,000	55.900	4,583,800.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	945,000	1.480	1,398,600.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	40,000	30.300	1,212,000.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	111,000	11.940	1,325,340.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	140,000	36.950	5,173,000.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	53.950	312,910.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	94,000	14.140	1,329,160.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	28,000	16.400	459,200.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	3,000	186.800	560,400.000	

	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	115,000	10.720	1,232,800.000	
	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	102,000	34.050	3,473,100.000	
	CHINA FEIHE LTD	104,000	17.340	1,803,360.000	
	PHARMARON BEIJING CO LTD	9,100	107.000	973,700.000	
	SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	45.950	1,608,250.000	
	CHINA BOHAI BANK CO LTD	72,000	4.400	316,800.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,300	156.200	1,296,460.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	145,061	26.100	3,786,092.100	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	109,500	3.870	423,765.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	43,000	39.400	1,694,200.000	
	CGN POWER CO LTD	863,000	1.560	1,346,280.000	
	GF SECURITIES CO LTD	68,200	10.620	724,284.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	53,200	34.950	1,859,340.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	129,400	11.820	1,529,508.000	
	3SBIO INC	64,000	6.850	438,400.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	3.930	369,420.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,198,000	0.910	1,090,180.000	
	CHINA LITERATURE LTD	22,600	58.000	1,310,800.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.890	716,385.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	6.680	427,520.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	4.600	299,000.000	
	BOC AVIATION LTD	11,600	67.800	786,480.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	35,700	34.350	1,226,295.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	84,000	13.580	1,140,720.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	99,200	17.820	1,767,744.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	258,000	79.250	20,446,500.000	
香港・ドル	小計	74,670,835		1,038,606,692.900 (13,938,101,816)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	45,000	265.000	11,925,000.000	
	ACER INC	222,532	24.200	5,385,274.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	62,554	257.000	16,076,378.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	42,616	398.000	16,961,168.000	

ASIA CEMENT CORP	152,928	43.650	6,675,307.200	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	20,000	235.000	4,700,000.000	
TAIWAN BUSINESS BANK	569,267	9.600	5,464,963.200	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	66,000	117.500	7,755,000.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	64,000	131.000	8,384,000.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	90,000	82.200	7,398,000.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	47,975	87.200	4,183,420.000	
QUANTA COMPUTER INC	250,858	80.600	20,219,154.800	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	80,777	44.600	3,602,654.200	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	62,760	202.500	12,708,900.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	377,761	17.250	6,516,377.250	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	150,169	44.800	6,727,571.200	
CHINA STEEL CORP	986,058	23.650	23,320,271.700	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	228,973	22.050	5,048,854.650	
ADVANTECH CO LTD	32,675	315.000	10,292,625.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	408,304	20.500	8,370,232.000	
DELTA ELECTRONICS INC	155,663	248.000	38,604,424.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	90,000	88.300	7,947,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	289,427	108.500	31,402,829.500	
AU OPTRONICS CORP	626,194	15.100	9,455,529.400	
TAIWAN MOBILE CO LTD	139,800	97.900	13,686,420.000	
EVERGREEN MARINE CORP	234,820	28.900	6,786,298.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	204,824	27.700	5,673,624.800	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	28,768	189.000	5,437,152.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	14,322	395.000	5,657,190.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	50,285	317.500	15,965,487.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	295,633	89.900	26,577,406.700	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	273,594	79.300	21,696,004.200	
GIANT MANUFACTURING	27,151	273.500	7,425,798.500	
MEDIATEK INC	123,507	709.000	87,566,463.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	503,936	45.650	23,004,678.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	686,944	17.700	12,158,908.800	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,000	639.000	15,975,000.000	

FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	117,000	61.000	7,137,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	831,146	19.400	16,124,232.400	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	647,941	41.450	26,857,154.450	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	976,403	8.960	8,748,570.880	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	942,448	25.000	23,561,200.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,002,225	87.700	87,895,132.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	895,495	28.800	25,790,256.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	3,415.000	28,071,300.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	865,058	12.950	11,202,501.100	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	833,061	8.460	7,047,696.060	
INVENTEC CO LTD	195,005	24.100	4,699,620.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	196,845	49.050	9,655,247.250	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	738,443	11.050	8,159,795.150	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,367,048	19.300	26,384,026.400	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	855,977	20.600	17,633,126.200	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	58,560	98.700	5,779,872.000	
NAN YA PLASTICS CORP	397,828	67.800	26,972,738.400	
WISTRON CORP	212,916	31.650	6,738,791.400	
POU CHEN CORP	164,990	31.950	5,271,430.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	376,297	65.500	24,647,453.500	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	50,392	266.500	13,429,468.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	94,480	93.200	8,805,536.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	10,658	340.000	3,623,720.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	96,589	40.350	3,897,366.150	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	62,588	53.200	3,329,681.600	
STANDARD FOODS CORP	53,639	60.900	3,266,615.100	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	91,899	45.300	4,163,024.700	
TAIWAN CEMENT CORP	416,171	43.250	17,999,395.750	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,011,083	512.000	1,029,674,496.000	

	UNITED MICROELECTRONICS CORP	991,525	47.300	46,899,132.500	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	301,000	24.400	7,344,400.000	
	YAGEO CORP	32,160	509.000	16,369,440.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	151,000	30.800	4,650,800.000	
	INNOLUX CORPORATION	601,345	13.250	7,967,821.250	
	WPG HOLDINGS CO LTD	124,203	42.200	5,241,366.600	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	24,994	335.000	8,372,990.000	
	PEGATRON CORP	175,554	69.400	12,183,447.600	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,000	895.000	9,845,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	30,000	350.000	10,500,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	107,470	155.000	16,657,850.000	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	16,000	216.000	3,456,000.000	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,610.000	3,220,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	54,385	119.500	6,499,007.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	761,954	19.850	15,124,786.900	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	289,993	39.050	11,324,226.650	
	WIWYNN CORP	5,000	679.000	3,395,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	281,903	80.600	22,721,381.800	
	SILERGY CORP	6,000	2,285.000	13,710,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	19,000	630.000	11,970,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	326.000	3,260,000.000	
	台湾・ドル 小計	26,297,966		2,234,014,465.190 (8,221,173,232)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	256.830	1,839,673.290	
	BIDVEST GROUP LTD	23,315	162.900	3,798,013.500	
	CLICKS GROUP LTD	17,820	242.650	4,324,023.000	
	DISCOVERY LTD	34,594	132.780	4,593,391.320	
	GOLD FIELDS LTD	75,151	136.980	10,294,183.980	
	REMGRO LTD	41,000	94.550	3,876,550.000	
	NORTHAM PLATINUM LTD	31,792	191.990	6,103,746.080	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	48,261	64.650	3,120,073.650	
	EXXARO RESOURCES LTD	16,476	145.150	2,391,491.400	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	5,975	1,297.960	7,755,311.000	
	MTN GROUP LTD	145,266	67.590	9,818,528.940	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	32,760	327.950	10,743,642.000	
	FIRSTRAND LTD	377,325	48.290	18,221,024.250	

NASPERS LTD	35,528	3,111.830	110,557,096.240	
NEDBANK GROUP LTD	26,013	124.370	3,235,236.810	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,829	1,255.720	4,808,151.880	
SASOL LTD	48,915	139.670	6,831,958.050	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	43,480	130.940	5,693,271.200	
MR PRICE GROUP LTD	17,420	172.180	2,999,375.600	
STANDARD BANK GROUP LTD	100,591	123.110	12,383,758.010	
SPAR GROUP LTD/THE	17,948	184.410	3,309,790.680	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	95,372	35.710	3,405,734.120	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,005	130.750	3,661,653.750	
ABSA GROUP LTD	64,370	113.350	7,296,339.500	
TIGER BRANDS LTD	9,616	208.590	2,005,801.440	
SANLAM LTD	132,898	56.770	7,544,619.460	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	68,391	185.090	12,658,490.190	
KUMBA IRON ORE LTD	5,769	595.310	3,434,343.390	
RMI HOLDINGS	77,351	29.860	2,309,700.860	
VODACOM GROUP PTY LTD	55,489	123.000	6,825,147.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	40,081	88.990	3,566,808.190	
OLD MUTUAL LTD	362,240	11.800	4,274,432.000	
REINET INVESTMENTS SCA	13,606	274.780	3,738,656.680	
MULTICHOICE GROUP LTD	31,604	134.380	4,246,945.520	
SIBANYE STILLWATER LTD	192,487	55.220	10,629,132.140	
BID CORP LTD	29,555	272.850	8,064,081.750	
南アフリカ・ランド 小計	2,357,456		320,360,176.870 (2,220,096,026)	
合計	205,326,333		64,529,043,536 (64,529,043,536)	

(2) 株式以外の有価証券

2020年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・パーツ	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	5,205.750	
	タイ・パーツ 小計		9,465.000	5,205.750 (18,012)	
新株予約権証券 合計			9,465	18,012 (18,012)	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	19,600.000	1,574,664.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	36,300.000	1,595,385.000	
		ENERGISA SA	17,500.000	835,100.000	
		KLABIN SA	62,700.000	1,493,514.000	
		SUL AMERICA SA	27,781.000	1,238,754.790	
	ブラジル・リアル 小計		163,881.000	6,737,417.790 (139,599,297)	
メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,314,575.000	14,447,179.250		

		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	41,500.000	3,834,185.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	155,400.000	23,533,776.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	180,800.000	5,928,432.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	38,700.000	2,798,010.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,730,975.000	50,541,582.250 (262,816,227)	
投資信託受益証券 合計			1,894,856	402,415,524 (402,415,524)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	245,700.000	5,456,997.000	
	メキシコ・ペソ	小計	245,700.000	5,456,997.000 (28,376,384)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	317,258.000	4,064,074.980	
	南アフリカ・ランド	小計	317,258.000	4,064,074.980 (28,164,040)	
投資証券 合計			562,958	56,540,424 (56,540,424)	
合計				458,973,960 (458,973,960)	

(注) 新株予約権証券、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(%)	組入新株予約権証券時価比率(%)	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 62銘柄	14.77	-	-	-	16.20
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 9銘柄	0.51	-	-	-	0.56
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.07	-	-	-	0.08
インド・ルピー	株式 97銘柄	8.35	-	-	-	9.16
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.24	-	-	-	1.36
オフショア・人民元	株式 357銘柄	4.25	-	-	-	4.66
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.66	-	-	-	0.72
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.45	-	-	-	0.49
コロンビア・ペソ	株式 5銘柄	0.17	-	-	-	0.19
サウジアラビア・リアル	株式 36銘柄	2.29	-	-	-	2.51
タイ・バーツ	株式 43銘柄	1.78	-	-	-	1.95
	新株予約権証券 1銘柄	-	0.00	-	-	
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.09	-	-	-	0.10

チリ・ペソ	株式	14銘柄	0.45	-	-	-	0.50
トルコ・リラ	株式	14銘柄	0.31	-	-	-	0.34
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.19	-	-	-	0.21
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	20銘柄	0.69	-	-	-	0.76
ブラジル・リアル	株式	49銘柄	4.59	-	-	-	5.25
	投資信託受益証券	5銘柄	-	-	0.20	-	
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.66	-	-	-	0.72
マレーシア・リングgit	株式	38銘柄	1.45	-	-	-	1.59
メキシコ・ペソ	株式	19銘柄	1.20	-	-	-	1.77
	投資信託受益証券	5銘柄	-	-	0.37	-	
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.04	
ユーロ	株式	4銘柄	0.10	-	-	-	0.11
韓国・ウォン	株式	107銘柄	12.03	-	-	-	13.20
香港・ドル	株式	204銘柄	19.54	-	-	-	21.45
台湾・ドル	株式	87銘柄	11.53	-	-	-	12.65
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.11	-	-	-	3.46
	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）

2020年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,197,664,203
コール・ローン	146,341,085
国債証券	138,742,987,098
派生商品評価勘定	5,178,863
未収入金	1,566,406,202
未収利息	1,008,256,833
前払費用	777,606,906
流動資産合計	143,444,441,190
資産合計	
143,444,441,190	
負債の部	
流動負債	
未払金	546,036,899
未払解約金	2,002,734,000
流動負債合計	2,548,770,899
負債合計	
2,548,770,899	
純資産の部	
元本等	
元本	67,307,282,350
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,588,387,941
元本等合計	140,895,670,291
純資産合計	140,895,670,291
負債純資産合計	143,444,441,190

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基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	2020年12月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	58,588,416,226円
同期中追加設定元本額	56,873,439,537円
同期中一部解約元本額	48,154,573,413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）	114,153,365円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	780,460,017円
たわらノーロード バランス（堅実型）	58,394,739円
たわらノーロード バランス（標準型）	150,627,554円
たわらノーロード バランス（積極型）	60,019,356円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	567,077円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,356,452円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	3,581,235円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	902,323円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,014,405円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	44,240,071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）	225,010,486円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	432,325,092円
投資のソムリエ	19,662,165,166円
クルーズコントロール	524,608,006円
投資のソムリエ<DC年金>	1,357,033,933円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	183,350,267円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	3,815,462円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	8,877,202円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	850,976,607円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	8,952,855,905円
ワールドアセットバランス（基本コース）	741,096,435円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,579,591,505円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	19,527,848円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,230,374円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	8,102,725円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	43,052,809円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,518,561,840円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,665,974円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,297,067円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,840,666円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,991,692円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	15,989,286,190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)	2,544,861,219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)	604,836,047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)	10,823,406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)	224,697,703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)	110,993,577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)	4,370,913,639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)	1,714,438,828円
計	67,307,282,350円
2. 受益権の総数	67,307,282,350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 2020年6月12日 至 2020年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2020年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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	2020年12月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	3,383,060,741	
合計	3,383,060,741	

(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(2020年4月21日から2020年12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年12月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	2,000,000,000	-	1,994,821,137	5,178,863
合計	2,000,000,000	-	1,994,821,137	5,178,863

(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)

	2020年12月11日現在
1口当たり純資産額	2.0933円
(1万口当たり純資産額)	(20,933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

2020年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	9,800,000.000	10,155,250.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	16,100,000.000	17,550,207.500	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	10,000,000.000	11,060,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	13,800,000.000	15,410,253.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	9,000,000.000	9,482,715.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	12,800,000.000	14,102,336.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	9,100,000.000	10,703,875.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	11,600,000.000	13,697,338.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	9,800,000.000	11,680,375.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	7,300,000.000	9,913,801.500	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	9,200,000.000	13,369,440.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	6,800,000.000	8,487,080.000	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	9,000,000.000	9,439,875.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	10,600,000.000	11,777,236.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	9,100,000.000	9,820,492.500	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	8,000,000.000	9,070,840.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	10,000,000.000	11,523,200.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	18,000,000.000	21,802,500.000	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	8,697,500.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	11,000,000.000	14,085,500.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	10,000,000.000	13,275,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	8,400,000.000	12,148,584.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	5,900,000.000	7,167,910.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	12,400,000.000	13,676,307.200	
		CROATIA 6.0 01/26/24	15,400,000.000	17,733,562.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	11,358,000.000	12,488,177.790	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	13,380,000.000	15,261,763.200	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	12,000,000.000	13,681,860.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	9,000,000.000	15,977,556.000	
		INDONESIA 2.85 02/14/30	6,000,000.000	6,483,104.580	
INDONESIA 3.375 04/15/23	7,700,000.000	8,176,707.000			

INDONESIA 3.4 09/18/29	4,000,000.000	4,479,540.000	
INDONESIA 3.5 01/11/28	6,200,000.000	6,944,868.000	
INDONESIA 3.7 10/30/49	3,000,000.000	3,261,855.030	
INDONESIA 3.85 07/18/27	5,600,000.000	6,381,760.000	
INDONESIA 3.85 10/15/30	5,000,000.000	5,811,152.800	
INDONESIA 4.1 04/24/28	6,000,000.000	6,972,558.780	
INDONESIA 4.125 01/15/25	8,800,000.000	9,848,916.000	
INDONESIA 4.2 10/15/50	5,000,000.000	5,921,874.500	
INDONESIA 4.35 01/08/27	6,000,000.000	6,991,409.400	
INDONESIA 4.35 01/11/48	7,000,000.000	8,328,250.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	8,800,000.000	10,301,852.000	
INDONESIA 4.75 02/11/29	7,000,000.000	8,493,830.240	
INDONESIA 5.125 01/15/45	9,400,000.000	12,112,511.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	6,400,000.000	8,508,340.480	
INDONESIA 5.25 01/17/42	9,300,000.000	12,024,295.500	
INDONESIA 5.35 02/11/49	4,000,000.000	5,470,848.600	
INDONESIA 5.875 01/15/24	9,200,000.000	10,586,808.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	5,200,000.000	7,494,942.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	8,500,000.000	13,064,909.360	
INDONESIA 7.75 01/17/38	9,500,000.000	14,926,922.500	
PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	8,725,600.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,200,000.000	5,739,006.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	7,100,000.000	8,057,470.500	
PANAMA 4.5 04/01/56	11,000,000.000	13,915,000.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	11,706,468.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	9,900,000.000	14,418,360.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	5,800,000.000	7,350,456.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	6,900,000.000	10,642,008.000	
PERU 2.392 01/23/26	5,000,000.000	5,297,500.000	
PERU 2.783 01/23/31	10,000,000.000	10,782,500.000	
PERU 2.844 06/20/30	9,000,000.000	9,801,630.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,300,000.000	6,174,871.000	
PERU 5.625 11/18/50	11,000,000.000	16,822,245.000	
PERU 6.55 03/14/37	7,000,000.000	10,318,700.000	
PERU 7.35 07/21/25	6,300,000.000	7,987,770.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	9,000,000.000	9,937,395.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	8,000,000.000	9,216,802.400	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	9,000,000.000	10,340,910.000	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	8,000,000.000	9,304,400.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	8,800,000.000	10,399,444.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	9,800,000.000	10,925,492.950	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	5,800,000.000	7,637,672.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	6,600,000.000	8,207,859.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	5,600,000.000	7,990,669.730	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	8,000,000.000	11,696,960.000	

PHILIPPINES 7.75 01/14/31	7,100,000.000	10,906,061.500	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	8,800,000.000	14,479,164.740	
ROMANIA 4.375 08/22/23	13,000,000.000	14,171,300.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	13,600,000.000	15,171,656.800	
ROMANIA 5.125 06/15/48	6,600,000.000	8,384,164.800	
ROMANIA 6.125 01/22/44	5,400,000.000	7,560,118.800	
ROMANIA 6.75 02/07/22	4,500,000.000	4,813,470.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	8,517,000.000	9,913,788.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	13,400,000.000	15,276,201.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	18,400,000.000	21,387,019.200	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	5,800,000.000	6,076,051.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	15,400,000.000	17,777,667.600	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	14,400,000.000	15,832,440.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	18,000,000.000	22,692,870.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	26,000,000.000	35,452,950.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	14,000,000.000	19,215,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	8,200,000.000	11,669,666.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	9,200,000.000	9,570,704.800	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	10,000,000.000	10,588,850.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	8,400,000.000	9,167,373.600	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	8,200,000.000	8,209,553.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	12,000,000.000	12,008,400.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,210,300.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	7,400,000.000	8,368,926.400	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	15,200,000.000	17,354,144.000	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,000,000.000	4,273,320.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	11,000,000.000	11,778,030.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	10,200,000.000	11,347,908.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	1,900,000.000	1,971,269.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	10,200,000.000	11,361,525.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	10,500,000.000	11,487,997.500	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	9,000,000.000	10,294,380.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	9,400,000.000	10,790,025.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	8,000,000.000	8,902,360.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	11,000,000.000	12,459,700.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	15,000,000.000	17,405,625.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	10,000,000.000	11,440,350.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	9,400,000.000	10,723,567.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	9,000,000.000	10,665,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	7,000,000.000	8,494,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	11,400,000.000	14,592,114.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,800,000.000	12,537,189.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	12,900,000.000	16,999,039.500	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	13,200,000.000	17,932,200.000	
	アメリカ・ドル 小計	1,106,255,000.000 (115,061,582,550)	1,333,938,920.280 (138,742,987,098)	
国債証券 合計		115,061,582,550 (115,061,582,550)	138,742,987,098 (138,742,987,098)	
合計			138,742,987,098 (138,742,987,098)	

(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	98.47	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ワールドアセットバランス(基本コース)

2020年12月30日現在

資産総額	10,370,099,528円
負債総額	19,841,631円
純資産総額(-)	10,350,257,897円
発行済数量	8,964,699,453口
1口当たり純資産額(/)	1.1546円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2020年12月30日現在

資産総額	35,362,091,020円
負債総額	54,611,890円
純資産総額(-)	35,307,479,130円
発行済数量	32,929,418,007口
1口当たり純資産額(/)	1.0722円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

資産総額	420,136,002,436円
負債総額	4,584,701円
純資産総額(-)	420,131,417,735円
発行済数量	95,364,285,537口
1口当たり純資産額(/)	4.4055円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

資産総額	545,247,974,666円
負債総額	4,330,402,260円
純資産総額(-)	540,917,572,406円
発行済数量	365,067,089,499口
1口当たり純資産額(/)	1.4817円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2020年12月30日現在

資産総額	52,895,233,859円
負債総額	250,116,530円
純資産総額(-)	52,645,117,329円
発行済数量	44,092,144,094口
1口当たり純資産額(/)	1.1940円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2020年12月30日現在

資産総額	73,128,237,919円
負債総額	58,659,030円
純資産総額(-)	73,069,578,889円
発行済数量	55,018,481,810口
1口当たり純資産額(/)	1.3281円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2020年12月30日現在

資産総額	145,707,609,728円
負債総額	152,093,250円
純資産総額(-)	145,555,516,478円
発行済数量	69,226,672,953口
1口当たり純資産額(/)	2.1026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(2020年12月30日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2020年12月30日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年12月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,464,062,940,755
追加型株式投資信託	854	14,848,882,807,715
単位型公社債投資信託	33	76,307,267,611
単位型株式投資信託	199	1,283,935,326,989
合計	1,112	17,673,188,343,070

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、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、第35期事業年度（自2019年4月1日至2020年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第36期中間会計期間（自2020年4月1日至2020年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
建物	1 1,096,916	1 1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
ソフトウェア仮勘定	1,522,040	221,784
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
長期差入保証金	4,499,196	5,299,196
繰延税金資産	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(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	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	-		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	-		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	-		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1 19,121		1 16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

(3)【株主資本等変動計算書】

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責任準備 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	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			-	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

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								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	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

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。

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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自2018年4月1日至2019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
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018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
2019年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種 類株式					

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
2020年6月17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
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					

（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34期(2019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	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

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	-

(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、株式は取引所の価格によっており、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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	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 その他有価証券」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34期(2019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	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

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 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

（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34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35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、記載しておりません。

2. その他有価証券

第34期（2019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	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
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	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

（注）非上場株式（貸借対照表計上額276,764千円）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。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

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

(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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020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% ~ 4.42%

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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

(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34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
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	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

(2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64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	5,241,252千円	5,149,555千円

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

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。

(2) 子会社及び関連会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

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。

(3) 兄弟会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
子 会 社	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	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

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
子 会 社	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

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) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

(注3) 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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,281,363
金銭の信託		25,870,423
有価証券		996
未収委託者報酬		13,747,204
未収運用受託報酬		3,023,356
未収投資助言報酬		304,673
未収収益		24,940
前払費用		757,672
その他		2,912,168
	流動資産計	73,922,799
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	961,771
器具備品	1	237,569
無形固定資産		
ソフトウェア		3,099,921
ソフトウェア仮勘定		556,224
電話加入権		3,931
投資その他の資産		
投資有価証券		261,361
関係会社株式		5,299,196
長期差入保証金		1,295,930
繰延税金資産		2,294,343
その他		793,037
	固定資産計	14,803,286
資産合計		88,726,085

(単位:千円)

	第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,297,202
未払金	5,820,782
未払収益分配金	899
未払償還金	19,850
未払手数料	5,549,722
その他未払金	250,310
未払費用	7,902,650
未払法人税等	2,901,506
未払消費税等	824,900
前受収益	20,779
賞与引当金	1,126,713
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	19,928,648
固定負債	
退職給付引当金	2,207,043
時効後支払損引当金	156,886
固定負債計	2,363,929
負債合計	22,292,578
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	44,880,558
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	44,757,265
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	13,077,265
株主資本計	66,433,515
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	8
評価・換算差額等計	8
純資産合計	66,433,506
負債・純資産合計	88,726,085

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	40,520,928	
運用受託報酬	6,813,891	
投資助言報酬	548,146	
その他営業収益	773,786	
	営業収益計	48,656,752
営業費用		
支払手数料	16,685,574	
広告宣伝費	116,359	
調査費	12,452,140	
調査費	4,305,114	
委託調査費	8,147,025	
委託計算費	269,176	
営業雑経費	450,999	
通信費	24,247	
印刷費	314,201	
協会費	20,394	
諸会費	32,852	
支払販売手数料	59,302	
	営業費用計	29,974,250
一般管理費		
給料	4,693,004	
役員報酬	75,939	
給料・手当	4,496,351	
賞与	120,714	
交際費	5,108	
寄付金	6,331	
旅費交通費	20,383	
租税公課	277,754	
不動産賃借料	734,008	
退職給付費用	267,068	
固定資産減価償却費	1 534,020	
福利厚生費	17,379	
修繕費	511	
賞与引当金繰入額	1,126,713	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	139	
事務委託費	1,899,643	
事務用消耗品費	35,787	
器具備品費	265	
諸経費	66,792	
	一般管理費計	9,719,026
営業利益		8,963,474

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	17,653	
受取配当金	2,356	
時効成立分配金・償還金	176	
時効後支払損引当金戻入額	16,343	
為替差益	8,484	
金銭の信託運用損益	1,367,091	
雑収入	1,361	
営業外収益計		1,413,467
経常利益		10,376,942
特別損失		
固定資産除却損	0	
特別損失計		0
税引前中間純利益		10,376,942
法人税、住民税及び事業税		2,957,106
法人税等調整額		213,661
法人税等合計		3,170,767
中間純利益		7,206,174

(3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,000,000
中間純利益							7,206,174
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,793,825
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	13,077,265

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	49,674,383	71,227,341	7	7	71,227,333
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,000,000	12,000,000			12,000,000
中間純利益	7,206,174	7,206,174			7,206,174
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	4,793,825	4,793,825	0	0	4,793,826
当中間期末残高	44,800,558	66,433,515	8	8	66,433,506

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：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 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、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 …… 6～18年 器具備品 …… 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第36期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	365,042千円
	器具備品	980,577千円

（中間損益計算書関係）

項目	第36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1. 減価償却実施額	有形固定資産	79,115千円
	無形固定資産	454,905千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2020年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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)。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	27,281,363	27,281,363	-
(2) 金銭の信託	25,870,423	25,870,423	-
(3) 未収委託者報酬	13,747,204	13,747,204	-
(4) 未収運用受託報酬	3,023,356	3,023,356	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,987	2,987	-
資産計	69,925,335	69,925,335	-
(1) 未払手数料	5,549,722	5,549,722	-
負債計	5,549,722	5,549,722	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これ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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	259,369
関係会社株式	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。

(有価証券関係)

第36期中間会計期間末

(2020年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299,196千円)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、記載しておりません。

2. その他有価証券

区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	2,987	3,000	12
小計	2,987	3,000	12
合計	2,987	3,000	12

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額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。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2020年4月1日から2020年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

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。

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

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

流動資産	- 千円
固定資産	90,405,440千円
資産合計	90,405,440千円
流動負債	- 千円
固定負債	7,722,834千円
負債合計	7,722,834千円
純資産	82,682,605千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額60,979,870千円及び顧客関連資産の金額32,301,694千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,411,813千円
経常利益	4,411,813千円
税引前中間純利益	4,411,813千円
中間純利益	3,644,417千円
1株当たり中間純利益	91,110円42銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,508,336千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,660,837円67銭
1株当たり中間純利益金額	180,154円36銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益金額	7,206,174千円
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中間純利益金額	7,206,174千円
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
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
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

2020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「販売会社一覧表」の通りです。

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

(注) 資本金の額は2020年3月末日現在

(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

2020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、各ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・ 金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・ 詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・ 目論見書の使用開始日
- ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・ 投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年5月27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 山野 浩 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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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2020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。

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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年1月22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」に掲げられているワールドアセットバランス（基本コース）の2020年6月12日から2020年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス（基本コース）の2020年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

（注1）上記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。

独立監査人の監査報告書

2021年1月22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 長谷川 敬 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」に掲げられているワールドアセットバランス(リスク抑制コース)の2020年6月12日から2020年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)の2020年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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) 上記は中間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 データは中間監査の対象には含まれておりません。