

【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】	2022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:2022年3月12日から2022年9月13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】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を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、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。

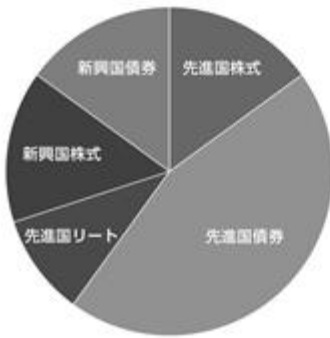
※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。

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用い、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。

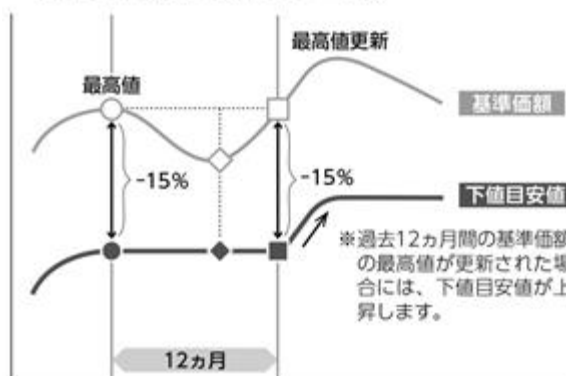
(リスク抑制コース)の下値目安値について

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。

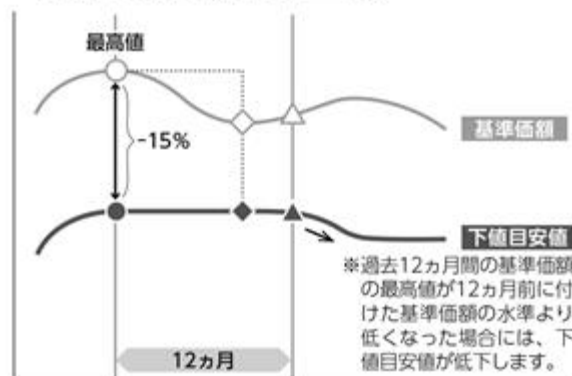
※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

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。

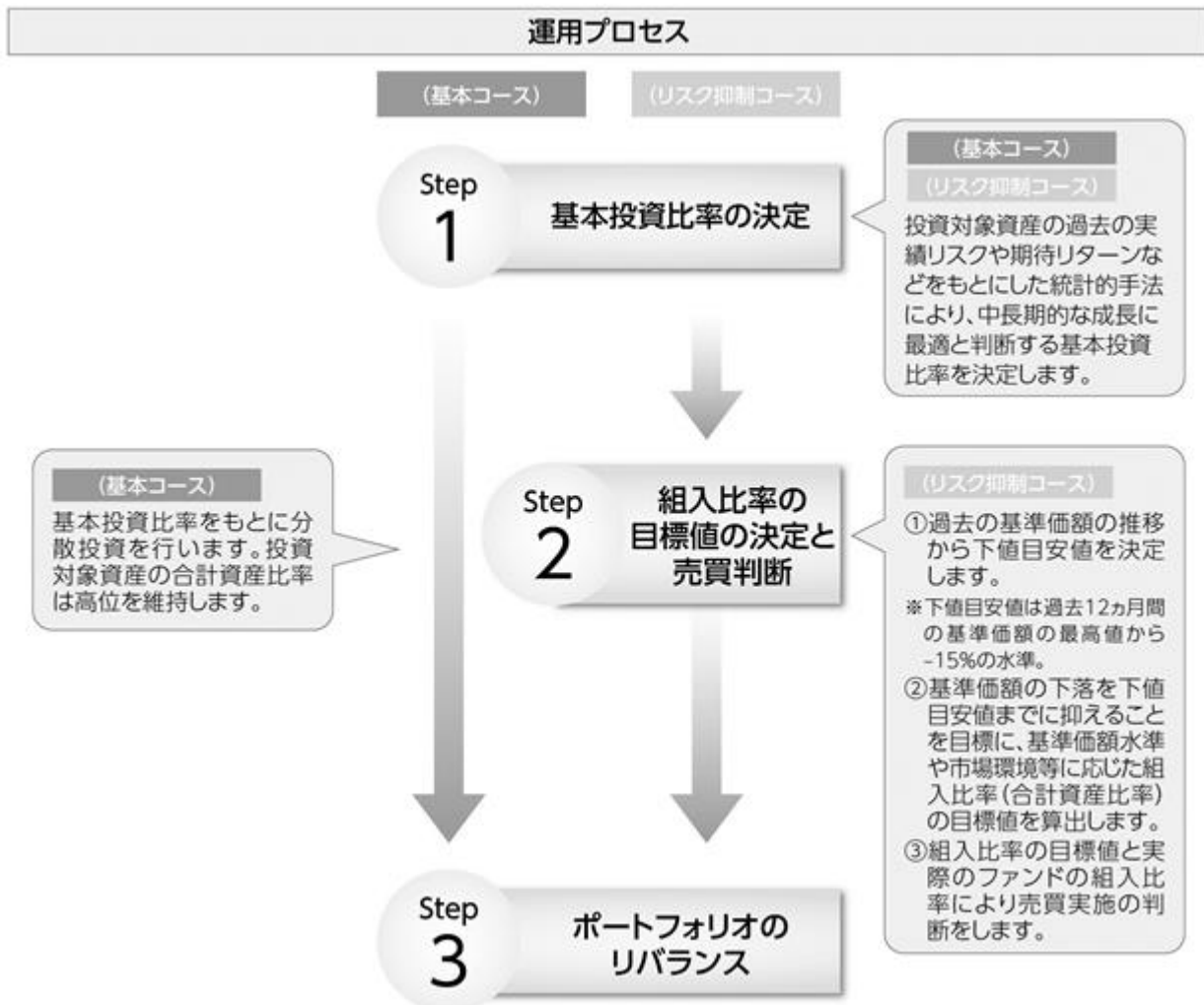
4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

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)	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 ()	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東)	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
資産複合 (投資信託証 券(債券、株 式、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。

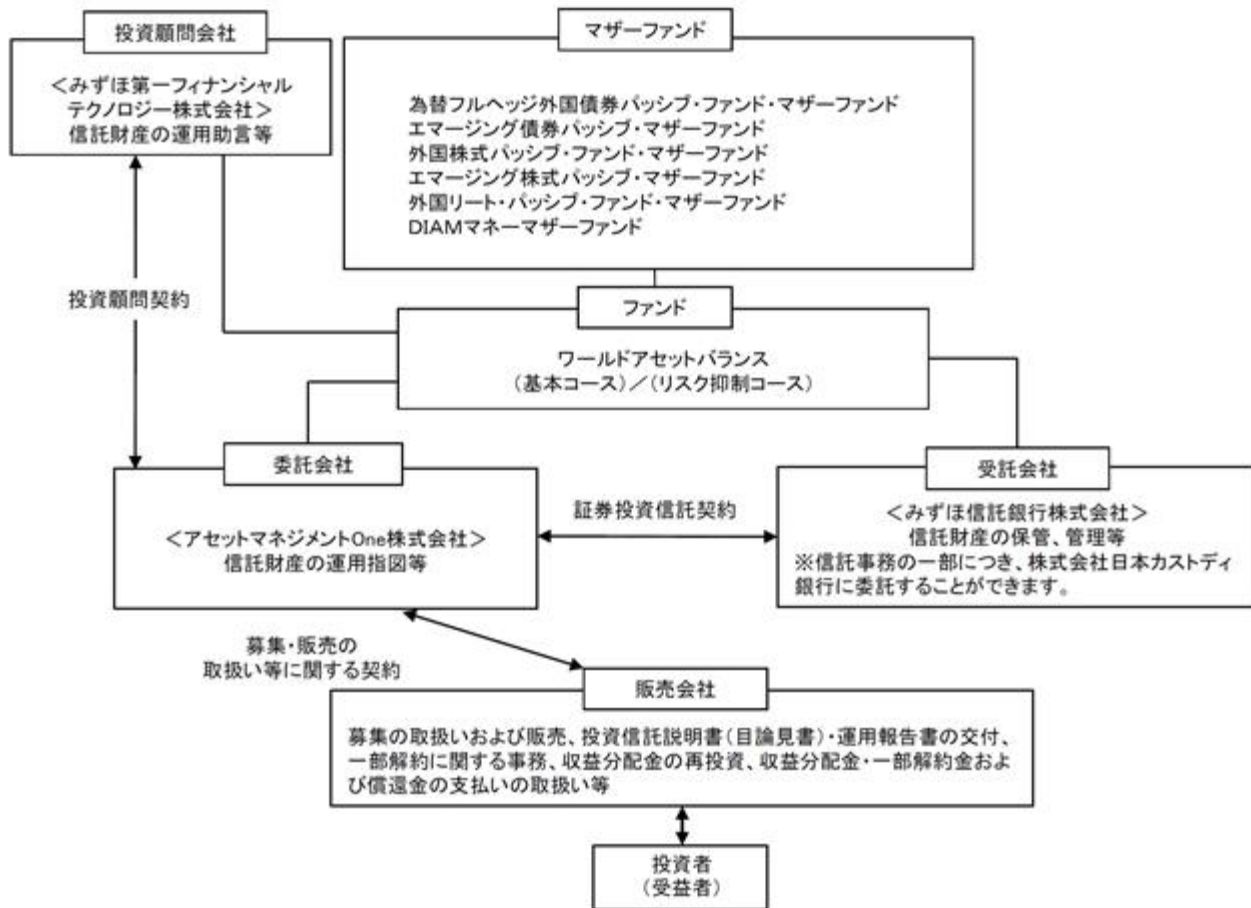
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

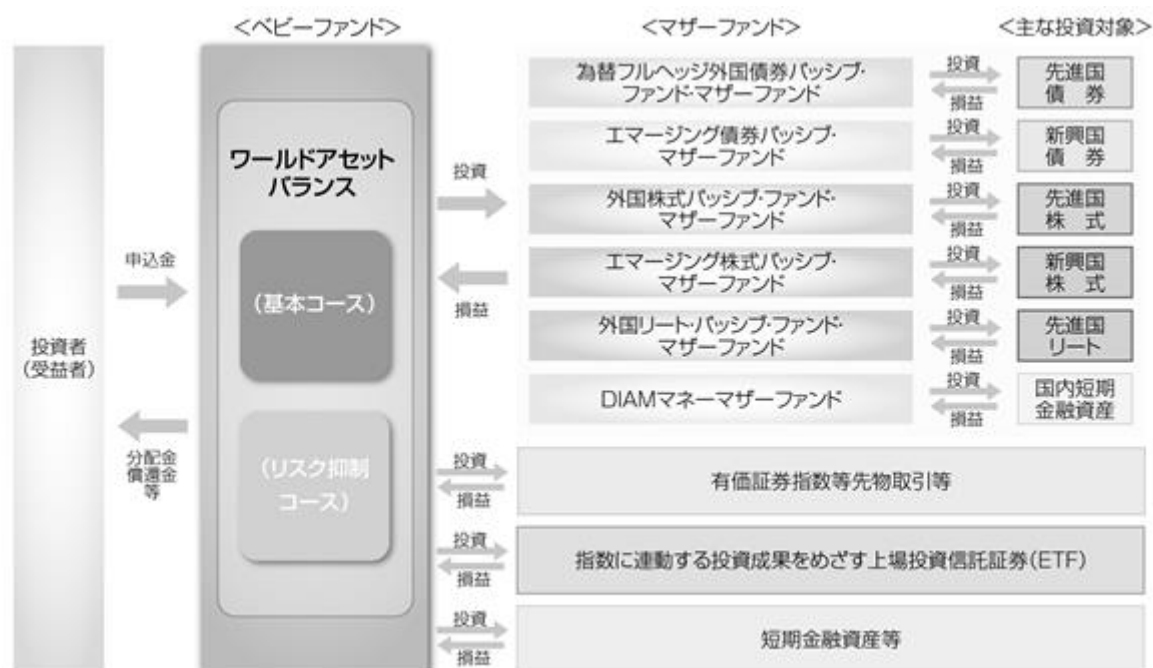
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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（2021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

(2021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。)

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

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

7. 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

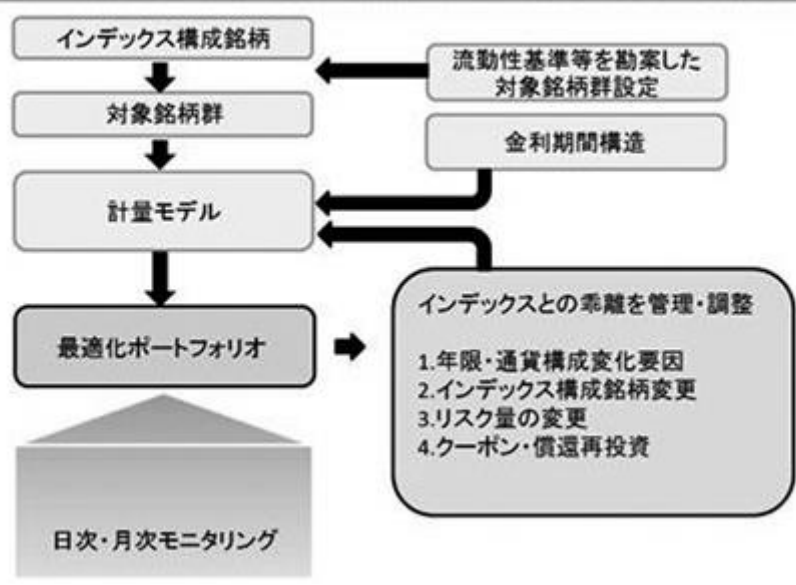
なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin-top: 20px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<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。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日々・月次モニタリング] F[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] subgraph H [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>

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

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

認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

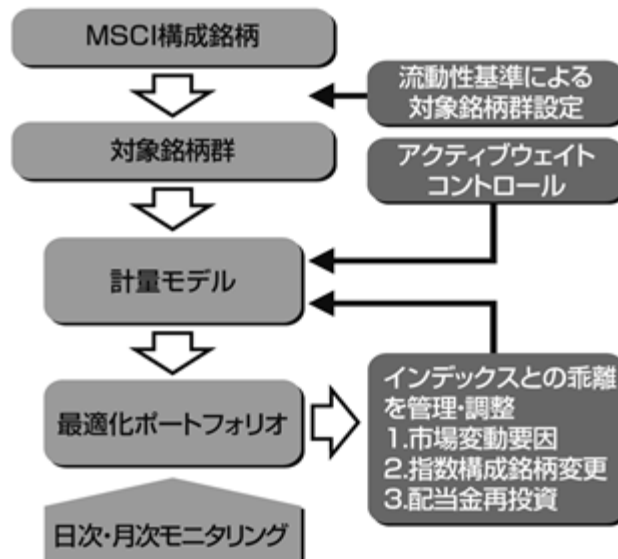
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

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

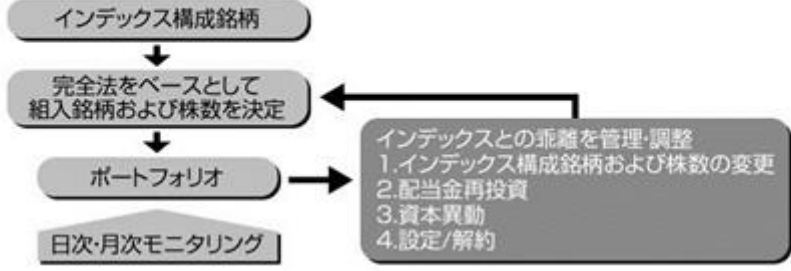
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

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 (「SPDJ」) 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、SPDJ、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。
--------	--

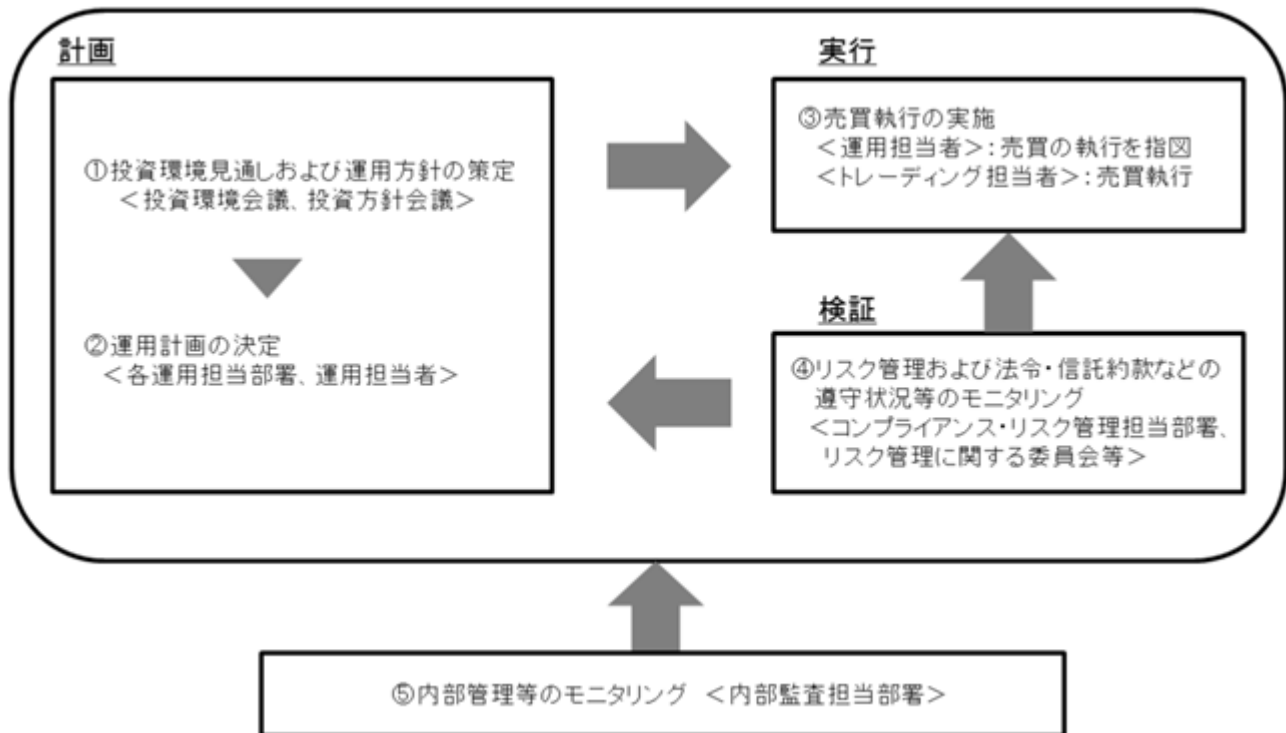
ファンド名	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1.国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CP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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021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、金利先渡し取引、為替先渡し取引、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て、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。

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。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。

基準価額的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。

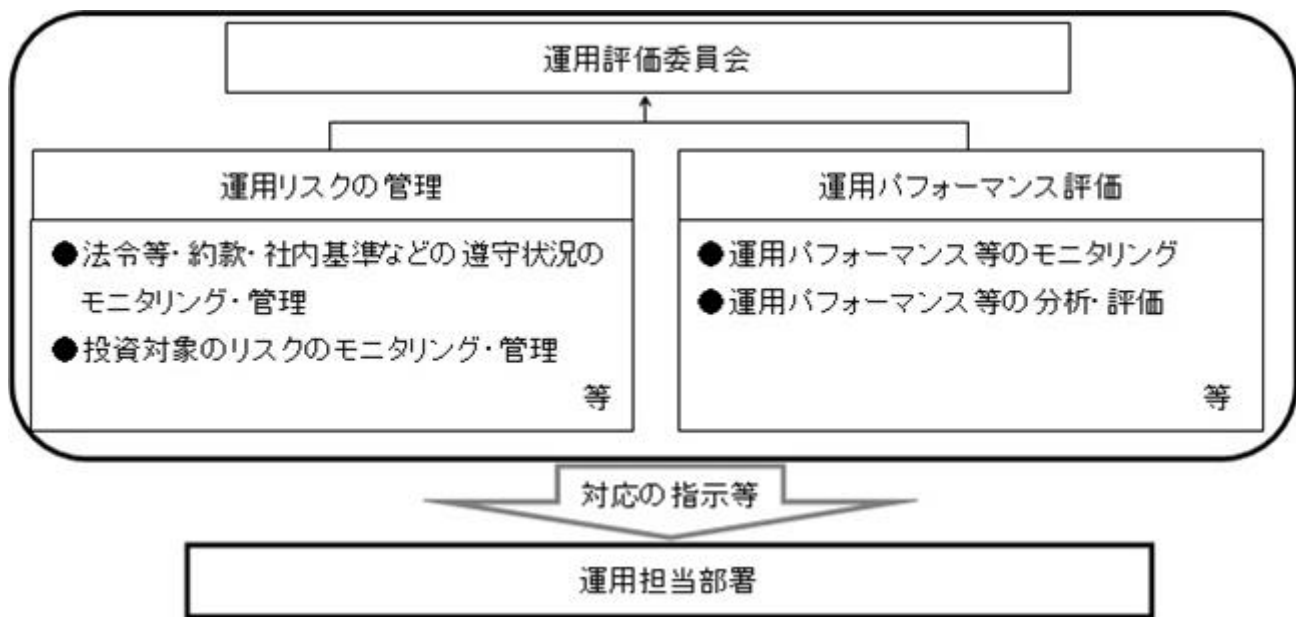
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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。
- ・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



リスク管理体制は2021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。

流動性リスク管理体制

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

流動性リスク管理体制は2022年1月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

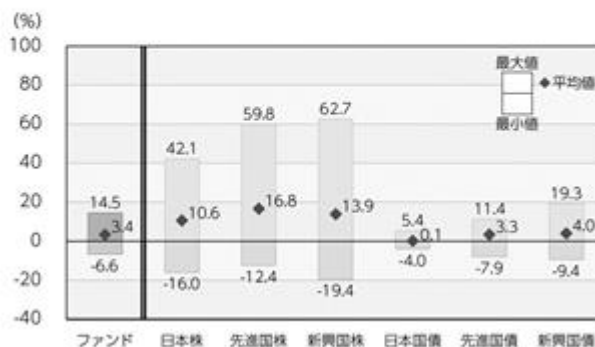
<参考情報>

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)

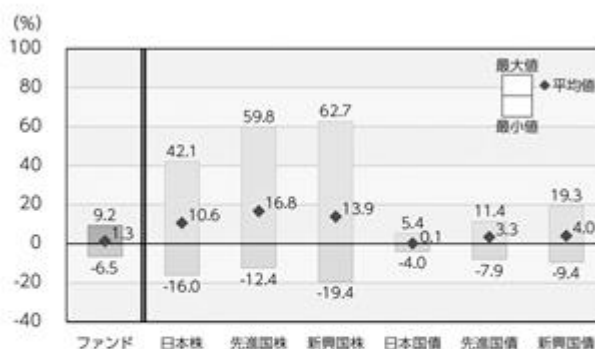


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年1月~2021年12月
代表的な資産クラス:2017年1月~2021年12月

(リスク抑制コース)



ファンド:2018年1月~2021年12月
代表的な資産クラス:2017年1月~2021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、日本の株式市場を広くに網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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、株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・セクレティーズ・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・セクレティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込時に、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、2021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「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ワールドアセットバランス(基本コース)

2021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	40,209,899	0.48
内 アメリカ	40,209,899	0.48
親投資信託受益証券	8,355,910,315	98.93
内 日本	8,355,910,315	98.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	50,120,850	0.59
純資産総額	8,446,241,064	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)

2021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	61,977,664	0.24
内 アメリカ	61,977,664	0.24
親投資信託受益証券	22,273,869,131	86.67
内 日本	22,273,869,131	86.67
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,364,089,714	13.09
純資産総額	25,699,936,509	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

2021年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	717,516,795,641	95.70
内 アメリカ	507,854,638,992	67.73
内 イギリス	29,530,085,639	3.94
内 カナダ	25,726,935,625	3.43
内 スイス	24,775,894,518	3.30
内 フランス	23,089,451,376	3.08
内 ドイツ	18,913,524,615	2.52
内 オランダ	14,683,237,561	1.96
内 アイルランド	13,714,114,724	1.83
内 オーストラリア	13,623,944,056	1.82
内 スウェーデン	8,123,252,302	1.08
内 デンマーク	5,837,320,863	0.78
内 スペイン	4,902,259,078	0.65
内 香港	4,470,166,780	0.60
内 イタリア	3,915,823,287	0.52
内 ジャージー	2,924,249,579	0.39
内 フィンランド	2,728,613,154	0.36
内 シンガポール	1,931,944,291	0.26
内 ベルギー	1,681,371,229	0.22
内 バミューダ	1,634,800,881	0.22

内	イスラエル	1,527,045,905	0.20
内	ノルウェー	1,403,916,181	0.19
内	ケイマン諸島	1,318,033,379	0.18
内	ルクセンブルグ	646,333,047	0.09
内	ニュージーランド	604,850,082	0.08
内	オランダ領キュラソー	529,346,619	0.07
内	オーストリア	526,749,662	0.07
内	ポルトガル	330,773,963	0.04
内	リベリア	212,784,839	0.03
内	パナマ	205,543,643	0.03
内	マン島	149,789,771	0.02
投資信託受益証券		1,325,062,124	0.18
内	オーストラリア	1,025,047,009	0.14
内	シンガポール	300,015,115	0.04
投資証券		16,178,529,107	2.16
内	アメリカ	15,118,558,553	2.02
内	イギリス	478,304,046	0.06
内	フランス	266,765,197	0.04
内	香港	242,948,430	0.03
内	カナダ	71,952,881	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		14,772,580,130	1.97
純資産総額		749,792,967,002	100.00

その他資産の投資状況

2021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)	21,458,132,618	2.86	
内	アメリカ	16,289,270,424	2.17
内	ドイツ	3,229,182,828	0.43
内	イギリス	926,170,378	0.12
内	カナダ	719,693,321	0.10
内	オーストラリア	293,815,667	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

2021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	444,280,925,151	100.36	
内	アメリカ	212,294,558,052	47.96
内	フランス	44,279,582,883	10.00
内	イタリア	39,178,685,687	8.85
内	ドイツ	31,942,323,665	7.22
内	イギリス	26,497,229,792	5.99
内	スペイン	25,962,951,654	5.87
内	ベルギー	10,006,162,544	2.26
内	カナダ	8,656,948,439	1.96
内	オランダ	8,474,088,856	1.91

内 オーストラリア	7,329,225,773	1.66
内 オーストリア	6,123,011,966	1.38
内 アイルランド	3,544,178,548	0.80
内 メキシコ	3,087,967,793	0.70
内 フィンランド	2,677,845,950	0.60
内 ポーランド	2,121,337,625	0.48
内 イスラエル	2,071,810,161	0.47
内 マレーシア	1,969,353,745	0.44
内 デンマーク	1,948,146,799	0.44
内 シンガポール	1,945,385,346	0.44
内 中国	1,827,345,400	0.41
内 スウェーデン	1,282,711,081	0.29
内 ノルウェー	1,060,073,392	0.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,606,790,108	0.36
純資産総額	442,674,135,043	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

2021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	9,356,013,911	10.17
内 オーストラリア	6,370,978,816	6.92
内 シンガポール	2,906,291,335	3.16
内 香港	78,743,760	0.09
投資証券	82,816,783,322	89.99
内 アメリカ	70,670,107,516	76.79
内 イギリス	4,912,570,591	5.34
内 カナダ	1,702,091,210	1.85
内 フランス	1,533,179,900	1.67
内 ベルギー	1,200,546,411	1.30
内 香港	1,145,933,480	1.25
内 スペイン	351,777,845	0.38
内 ニュージーランド	340,771,203	0.37
内 ドイツ	256,482,806	0.28
内 ガーンジー	231,041,435	0.25
内 韓国	151,333,023	0.16
内 オランダ	138,200,420	0.15
内 アイルランド	94,105,044	0.10
内 イスラエル	68,461,583	0.07
内 イタリア	20,180,855	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	140,740,084	0.15
純資産総額	92,032,057,149	100.00

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	60,913,641,548	87.96

内 ケイマン諸島	11,406,037,387	16.47
内 台湾	9,681,771,412	13.98
内 韓国	8,008,611,820	11.56
内 インド	7,647,806,700	11.04
内 中国	7,306,055,214	10.55
内 ブラジル	2,288,252,384	3.30
内 サウジアラビア	2,043,782,149	2.95
内 南アフリカ	1,883,975,858	2.72
内 ロシア	1,869,462,450	2.70
内 タイ	1,031,428,699	1.49
内 メキシコ	964,284,740	1.39
内 インドネシア	900,688,496	1.30
内 マレーシア	851,985,497	1.23
内 香港	706,482,158	1.02
内 アラブ首長国連邦	705,486,957	1.02
内 カタール	502,178,698	0.73
内 フィリピン	459,456,470	0.66
内 ポーランド	437,728,475	0.63
内 クエート	376,598,439	0.54
内 パミュエダ	306,889,698	0.44
内 チリ	241,448,258	0.35
内 アメリカ	194,527,474	0.28
内 オランダ	168,000,452	0.24
内 トルコ	167,134,733	0.24
内 ハンガリー	143,981,434	0.21
内 ギリシャ	137,678,823	0.20
内 コロンビア	112,906,613	0.16
内 キプロス	90,476,877	0.13
内 チェコ	73,825,482	0.11
内 ジャージー	49,231,820	0.07
内 エジプト	48,301,115	0.07
内 ルクセンブルグ	46,192,511	0.07
内 マン島	25,380,383	0.04
内 ペルー	15,326,102	0.02
内 イギリス領バージン諸島	13,141,520	0.02
内 シンガポール	7,124,250	0.01
投資信託受益証券	368,493,274	0.53
内 メキシコ	258,046,081	0.37
内 ブラジル	110,447,193	0.16
投資証券	46,587,654	0.07
内 メキシコ	28,175,135	0.04
内 南アフリカ	18,412,519	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,926,705,078	11.45
純資産総額	69,255,427,554	100.00

その他資産の投資状況

2021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)	8,651,628,419	12.49
内 アメリカ	8,651,628,419	12.49

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	139,728,499,560	97.65
内 メキシコ	22,568,962,688	15.77
内 インドネシア	19,037,729,668	13.30
内 ロシア	18,566,745,381	12.97
内 ブラジル	15,237,033,817	10.65
内 フィリピン	12,498,891,838	8.73
内 コロンビア	11,609,870,930	8.11
内 南アフリカ	9,469,063,018	6.62
内 パナマ	9,122,833,266	6.38
内 ベルギー	7,595,305,442	5.31
内 ハンガリー	5,997,380,614	4.19
内 ルーマニア	5,194,958,099	3.63
内 クロアチア	2,829,724,799	1.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,368,456,678	2.35
純資産総額	143,096,956,238	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）

2021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	2,610,143,124	1.4467 3,776,094,058	1.4304 3,733,548,724	- -	44.20
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	210,986,462	5.9111 1,247,162,076	6.1010 1,287,228,404	- -	15.24
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	564,481,924	2.2200 1,253,149,872	2.2441 1,266,753,885	- -	15.00
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	833,770,619	1.4426 1,202,880,872	1.4363 1,197,544,740	- -	14.18
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	485,577,430	1.6966 823,879,225	1.7934 870,834,562	- -	10.31

6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益証券	13,300	3,109.79 41,360,283	3,023.30 40,209,899	- -	0.48
---	--	----------	--------	------------------------	------------------------	--------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.48
親投資信託受益証券	98.93
合計	99.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2021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	6,895,234,427	1.4467 9,975,335,646	1.4304 9,862,943,324	- -	38.38
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	563,898,465	5.9111 3,333,260,217	6.1010 3,440,344,534	- -	13.39
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	1,500,192,882	2.2199 3,330,428,198	2.2441 3,366,582,846	- -	13.10
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	2,266,971,500	1.4427 3,270,559,784	1.4363 3,256,051,165	- -	12.67
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	1,309,215,603	1.6966 2,221,346,113	1.7934 2,347,947,262	- -	9.14
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益証券	20,500	3,109.79 63,750,812	3,023.30 61,977,664	- -	0.24

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.24
親投資信託受益証券	86.67
合計	86.91

(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

2021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	1,799,234	16,389.43 29,488,428,229	20,632.28 37,122,313,347	- -	4.95
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	776,979	30,911.39 24,017,506,748	39,331.08 30,559,430,200	- -	4.08
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	49,620	382,241.07 18,966,801,962	389,229.98 19,313,591,627	- -	2.58
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	91,630	94,124.05 8,624,587,499	124,933.57 11,447,663,367	- -	1.53
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	32,761	273,883.07 8,972,683,399	337,365.16 11,052,420,072	- -	1.47
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	31,358	274,392.76 8,604,408,390	337,018.95 10,568,240,290	- -	1.41
7	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	259,479	34,475.67 8,945,714,688	39,444.95 10,235,138,464	- -	1.37
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	272,259	21,552.20 5,867,781,639	34,507.15 9,394,882,206	- -	1.25

9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	102,610	43,245.34 4,437,404,677	58,151.81 5,966,957,388	- -	0.80
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	324,869	17,231.93 5,598,120,455	18,237.57 5,924,821,518	- -	0.79
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	286,368	19,229.25 5,506,642,366	19,731.68 5,650,522,024	- -	0.75
12	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	114,889	35,801.78 4,113,230,849	47,254.81 5,429,058,647	- -	0.72
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	263,869	15,589.99 4,113,715,957	18,885.13 4,983,201,370	- -	0.66
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	143,775	30,024.60 4,316,787,014	34,443.88 4,952,170,169	- -	0.66
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	305,638	13,537.95 4,137,712,659	16,140.03 4,933,009,056	- -	0.66
16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	183,803	24,874.03 4,571,922,846	25,093.91 4,612,336,564	- -	0.62
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	823,558	4,320.70 3,558,349,256	5,133.34 4,227,605,364	- -	0.56
18	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	45,059	73,394.01 3,307,061,067	91,813.78 4,137,037,338	- -	0.55
19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	611,320	4,666.98 2,853,021,265	6,622.85 4,048,681,640	- -	0.54
20	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	95,969	40,090.43 3,847,438,520	41,555.57 3,988,047,053	- -	0.53
21	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	76,372	41,713.41 3,185,736,774	47,901.98 3,658,370,322	- -	0.49
22	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	198,183	20,552.94 4,073,243,718	17,813.14 3,530,262,991	- -	0.47
23	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	44,626	57,907.26 2,584,169,415	77,363.60 3,452,428,111	- -	0.46
24	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	51,931	62,109.12 3,225,389,138	65,479.73 3,400,428,159	- -	0.45
25	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	48,219	64,614.79 3,115,660,621	70,224.31 3,386,146,042	- -	0.45

26	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	457,372	5,908.89 2,702,561,011	7,356.67 3,364,739,079	- -	0.45
27	ACCENTURE PLC-CL A アイルランド	株式 情報技術 サービス	68,833	33,672.94 2,317,809,712	47,781.60 3,288,951,450	- -	0.44
28	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサ イエ ス・ツ ール/サ ー ビス	42,876	61,724.67 2,646,507,217	76,227.20 3,268,317,624	- -	0.44
29	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消 耗 燃料	460,522	6,321.83 2,911,345,981	7,033.47 3,239,069,052	- -	0.43
30	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生 活必 需品 小 売 り	48,070	46,304.50 2,225,857,510	65,304.90 3,139,206,802	- -	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.70
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.16
合計	98.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021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	7.87
銀行		5.72
半導体・半導体製造装置		5.31
コンピュータ・周辺機器		5.22
医薬品		4.61
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.58
情報技術サービス		4.14
資本市場		3.26
石油・ガス・消耗燃料		3.08
インターネット販売・通信販売		3.06
保険		2.80
ヘルスケア機器・用品		2.53
自動車		2.25
化学		2.09
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.05
専門小売り		1.79
ホテル・レストラン・レジャー		1.77

機械	1.69
電力	1.66
バイオテクノロジー	1.64
飲料	1.58
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.57
繊維・アパレル・贅沢品	1.50
食品	1.49
食品・生活必需品小売り	1.41
娯楽	1.34
金属・鉱業	1.33
航空宇宙・防衛	1.27
各種電気通信サービス	1.16
家庭用品	1.11
陸運・鉄道	1.05
コングロマリット	1.02
メディア	0.92
各種金融サービス	0.88
電気設備	0.85
専門サービス	0.81
総合公益事業	0.80
通信機器	0.74
航空貨物・物流サービス	0.62
建設関連製品	0.62
電子装置・機器・部品	0.60
パーソナル用品	0.59
タバコ	0.58
複合小売り	0.48
消費者金融	0.44
商業サービス・用品	0.44
不動産管理・開発	0.39
商社・流通業	0.36
家庭用耐久財	0.35
容器・包装	0.26
建設資材	0.25
無線通信サービス	0.24
自動車部品	0.23
建設・土木	0.20
エネルギー設備・サービス	0.15
運送インフラ	0.13
ガス	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
水道	0.11
紙製品・林産品	0.11
販売	0.09
海運業	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08
旅客航空輸送業	0.04
レジャー用品	0.04
各種消費者サービス	0.01
合計	95.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

2021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 0.125 08/31/23 アメリカ	国債証 券	3,225,160,800	99.42 3,206,745,131	99.12 3,196,814,635	0.125 2023/8/31	0.72
2	US T N/B 1.375 09/30/23 アメリカ	国債証 券	2,807,638,200	101.87 2,860,197,187	101.21 2,841,746,595	1.375 2023/9/30	0.64
3	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	2,804,187,600	96.86 2,716,337,646	96.82 2,715,132,713	1.125 2031/2/15	0.61
4	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	2,480,981,400	101.53 2,519,100,132	101.02 2,506,469,588	1.625 2031/5/15	0.57
5	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	2,676,515,400	93.38 2,499,553,989	93.03 2,490,100,276	0.625 2030/8/15	0.56
6	US T N/B 0.25 09/30/23 アメリカ	国債証 券	2,410,819,200	99.60 2,401,296,464	99.28 2,393,585,602	0.25 2023/9/30	0.54
7	US T N/B 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証 券	2,300,400,000	99.20 2,282,042,808	98.59 2,268,140,478	0.25 2024/5/15	0.51
8	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証 券	2,426,922,000	93.88 2,278,588,527	93.27 2,263,768,382	0.625 2030/5/15	0.51
9	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	1,769,007,600	112.98 1,998,633,063	111.11 1,965,671,481	3.125 2028/11/15	0.44
10	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	1,684,884,100	113.89 1,918,921,241	112.87 1,901,772,490	1.5 2031/5/25	0.43
11	US T N/B 2.0 08/15/51 アメリカ	国債証 券	1,840,320,000	101.33 1,864,876,770	100.96 1,858,148,100	2 2051/8/15	0.42
12	US T N/B 2.875 05/15/49 アメリカ	国債証 券	1,544,718,600	119.11 1,840,066,122	119.48 1,845,697,363	2.875 2049/5/15	0.42
13	US T N/B 1.875 02/15/51 アメリカ	国債証 券	1,867,924,800	94.71 1,769,272,226	97.99 1,830,420,362	1.875 2051/2/15	0.41
14	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証 券	1,507,390,500	122.56 1,847,568,635	121.07 1,825,012,752	2.5 2030/5/25	0.41
15	FRANCE OAT 2.25 05/25/24 フランス	国債証 券	1,707,070,800	107.58 1,836,514,833	106.85 1,824,011,978	2.25 2024/5/25	0.41
16	US T N/B 1.25 09/30/28 アメリカ	国債証 券	1,840,320,000	99.21 1,825,809,076	98.68 1,816,165,800	1.25 2028/9/30	0.41
17	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証 券	1,671,240,600	109.55 1,830,987,685	108.07 1,806,114,929	2.625 2029/2/15	0.41
18	US T N/B 1.375 10/31/28 アメリカ	国債証 券	1,725,300,000	100.29 1,730,416,089	99.46 1,716,066,936	1.375 2028/10/31	0.39
19	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証 券	1,725,300,000	98.78 1,704,251,340	98.67 1,702,453,249	0.125 2024/2/15	0.38
20	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証 券	1,055,825,900	162.95 1,720,571,774	159.81 1,687,405,115	5.75 2032/10/25	0.38
21	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	965,774,000	174.53 1,685,622,226	171.08 1,652,265,474	4.5 2041/4/25	0.37
22	US T N/B 1.875 02/15/41 アメリカ	国債証 券	1,660,888,800	99.35 1,650,206,064	98.11 1,629,552,494	1.875 2041/2/15	0.37

23	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証券	1,653,987,600	99.55 1,646,557,572	98.40 1,627,627,172	1.125 2028/2/29	0.37
24	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	1,479,157,200	111.10 1,643,366,753	109.12 1,614,072,502	2.875 2028/8/15	0.36
25	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	1,659,738,600	97.03 1,610,577,142	96.67 1,604,565,253	0.375 2026/1/31	0.36
26	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,540,117,800	104.92 1,616,045,607	104.17 1,604,429,745	2.75 2024/2/15	0.36
27	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証券	1,579,224,600	100.78 1,591,558,344	100.31 1,584,159,676	1.5 2030/2/15	0.36
28	FRANCE OAT 0.0 11/25/30 フランス	国債証券	1,589,611,800	100.12 1,591,632,584	99.14 1,576,016,231	- 2030/11/25	0.36
29	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	1,514,813,400	104.71 1,586,293,656	102.91 1,559,015,169	2.125 2024/3/31	0.35
30	US T N/B 0.625 12/31/27 アメリカ	国債証券	1,628,683,200	96.56 1,572,665,406	95.57 1,556,664,864	0.625 2027/12/31	0.35

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	100.36
合計	100.36

(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

2021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	350,465	16,559.82 5,803,637,842	19,286.55 6,759,262,007	- -	7.34
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	42,691	93,330.15 3,984,357,821	96,846.83 4,134,488,446	- -	4.49
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	72,347	38,036.39 2,751,818,893	42,858.75 3,100,702,159	- -	3.37
4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	155,845	16,493.96 2,570,501,728	18,260.57 2,845,819,342	- -	3.09
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	134,592	18,543.17 2,495,762,632	20,158.40 2,713,160,072	- -	2.95
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	268,377	7,736.16 2,076,209,806	8,269.93 2,219,461,150	- -	2.41
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	206,498	9,539.95 1,969,982,338	9,789.35 2,021,481,650	- -	2.20
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	66,298	26,638.66 1,766,090,524	29,048.30 1,925,844,259	- -	2.09

9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	801,321	1,964.63 1,574,304,508	2,230.65 1,787,467,329	- -	1.94
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	66,913	23,442.59 1,568,614,554	25,715.02 1,720,669,226	- -	1.87
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	161,936	9,686.25 1,568,552,671	10,415.06 1,686,573,318	- -	1.83
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	63,537	22,061.22 1,401,704,145	25,927.80 1,647,375,162	- -	1.79
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	283,237	4,702.32 1,331,873,353	5,195.45 1,471,544,634	- -	1.60
14	MID AMERICA アメリカ	投資証券	54,649	22,983.66 1,256,034,483	26,260.21 1,435,094,555	- -	1.56
15	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	180,782	6,439.23 1,164,096,987	7,492.40 1,354,491,562	- -	1.47
16	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	55,051	22,210.57 1,222,714,126	24,201.35 1,332,308,970	- -	1.45
17	SEGRO PLC イギリス	投資証券	570,866	2,011.92 1,148,537,681	2,199.75 1,255,762,940	- -	1.36
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	30,900	38,032.79 1,175,213,225	40,511.19 1,251,795,900	- -	1.36
19	VENTAS INC アメリカ	投資証券	188,818	6,080.20 1,148,051,548	5,828.06 1,100,443,275	- -	1.20
20	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	254,313	3,958.72 1,006,754,868	4,152.22 1,055,964,033	- -	1.15
21	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	296,740	3,380.01 1,002,985,215	3,387.33 1,005,158,974	- -	1.09
22	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	48,220	18,199.10 877,560,728	20,434.45 985,349,333	- -	1.07
23	LINK REIT 香港	投資証券	982,420	1,035.13 1,016,934,298	1,002.26 984,642,725	- -	1.07
24	UDR INC アメリカ	投資証券	137,143	6,334.37 868,714,921	6,880.49 943,611,917	- -	1.03
25	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	67,084	13,300.60 892,257,516	13,294.01 891,815,474	- -	0.97
26	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	87,931	8,989.52 790,457,817	9,552.41 839,953,051	- -	0.91
27	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	136,680	5,429.08 742,046,684	6,068.45 829,436,456	- -	0.90
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	80,705	9,448.72 762,559,738	10,061.94 812,049,642	- -	0.88
29	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	290,995	2,569.11 747,598,272	2,789.23 811,653,438	- -	0.88
30	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	281,557	2,445.76 688,621,421	2,685.71 756,182,421	- -	0.82

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.17
投資証券	89.99
合計	100.15

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年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	1,685,083	2,509.61 4,228,902,801	2,562.43 4,317,918,690	- -	6.23
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	395,500	8,573.34 3,390,757,729	6,560.80 2,594,796,400	- -	3.75
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	326,897	7,792.47 2,547,335,634	7,667.23 2,506,397,754	- -	3.62
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	1,042,068	3,093.72 3,223,874,314	1,631.34 1,699,977,631	- -	2.45
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	278,500	4,119.67 1,147,328,621	3,186.00 887,301,000	- -	1.28
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	194,661	3,277.94 638,088,672	3,723.87 724,893,231	- -	1.05
7	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	232,734	2,308.41 537,246,993	2,922.60 680,188,970	- -	0.98
8	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	6,638,530	90.59 601,440,057	79.79 529,738,097	- -	0.76

9	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	103,507	3,953.06 409,170,232	4,929.36 510,223,576	- -	0.74
10	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	116,998	4,085.41 477,985,510	3,973.50 464,891,845	- -	0.67
11	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	37,069	12,180.57 451,521,790	12,357.09 458,065,339	- -	0.66
12	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	118,000	4,534.70 535,095,462	3,764.20 444,175,600	- -	0.64
13	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉄 業	280,089	2,020.52 565,926,432	1,558.83 436,612,669	- -	0.63
14	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	410,041	840.52 344,649,082	1,050.36 430,691,747	- -	0.62
15	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	348,649	985.08 343,447,886	1,140.33 397,576,657	- -	0.57
16	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	56,124	7,067.66 396,665,529	6,976.40 391,544,034	- -	0.57
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	853,225	487.23 415,722,027	436.77 372,670,762	- -	0.54
18	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	63,456	5,088.95 322,924,766	5,726.78 363,398,868	- -	0.52
19	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	433,500	1,160.96 503,278,919	837.80 363,186,300	- -	0.52
20	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	83,526	3,326.86 277,879,759	4,328.69 361,558,996	- -	0.52
21	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	189,038	1,917.07 362,399,268	1,812.14 342,563,340	- -	0.49

22	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	244,500	1,649.27 403,247,799	1,289.88 315,377,493	- -	0.46
23	NAVER CORP 韓国	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	8,364	38,385.91 321,059,766	37,168.59 310,878,170	- -	0.45
24	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	135,900	2,519.93 342,459,618	2,212.50 300,678,750	- -	0.43
25	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	92,389	4,357.54 402,589,461	3,249.31 300,200,963	- -	0.43
26	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	149,680	1,769.96 264,928,748	1,964.80 294,091,264	- -	0.42
27	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	18,735	22,495.38 421,451,054	15,677.22 293,712,829	- -	0.42
28	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	29,079	9,846.70 286,332,190	10,078.05 293,059,685	- -	0.42
29	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,297,878	88.34 203,007,350	121.03 278,117,137	- -	0.40
30	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	968,800	375.44 363,726,822	273.76 265,218,688	- -	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

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	87.96
投資信託受益証券	0.53
投資証券	0.07
合計	88.55

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年12月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
----	-------	---------

銀行	外国	12.14
半導体・半導体製造装置		9.39
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.43
コンピュータ・周辺機器		5.36
インターネット販売・通信販売		5.30
石油・ガス・消耗燃料		4.92
金属・鉱業		3.68
化学		2.80
自動車		2.77
電子装置・機器・部品		2.70
情報技術サービス		2.36
保険		2.34
不動産管理・開発		1.64
食品		1.62
無線通信サービス		1.54
各種電気通信サービス		1.20
医薬品		1.17
飲料		1.15
食品・生活必需品小売り		1.11
繊維・アパレル・贅沢品		1.06
娯楽		1.04
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.89
資本市場		0.88
コングロマリット		0.85
建設資材		0.82
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.76
バイオテクノロジー		0.75
ホテル・レストラン・レジャー		0.73
電気設備		0.71
各種金融サービス		0.71
電力		0.71
貯蓄・抵当・不動産金融		0.67
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.62
運送インフラ		0.55
ガス		0.53
専門小売り		0.53
自動車部品		0.52
建設・土木		0.51
海運業		0.50
消費者金融		0.49
機械		0.46
パーソナル用品		0.43
家庭用耐久財		0.37
家庭用品		0.36
タバコ		0.34
ソフトウェア		0.30
航空貨物・物流サービス		0.26
ヘルスケア機器・用品		0.24
複合小売り		0.20
陸運・鉄道		0.20

紙製品・林産品	0.17
通信機器	0.16
旅客航空輸送業	0.13
航空宇宙・防衛	0.13
メディア	0.11
商社・流通業	0.09
商業サービス・用品	0.09
各種消費者サービス	0.08
レジャー用品	0.08
水道	0.08
容器・包装	0.05
エネルギー設備・サービス	0.05
建設関連製品	0.04
ヘルスケア・テクノロジー	0.03
総合公益事業	0.03
専門サービス	0.02
合計	87.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021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	3,105,540,000	126.63 3,932,653,190	126.51 3,929,085,730	5.25 2047/6/23	2.75
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	2,300,400,000	119.92 2,758,668,435	118.00 2,714,472,000	5.1 2035/3/28	1.90
3	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	2,070,360,000	111.53 2,309,257,690	109.47 2,266,547,313	4.75 2026/5/27	1.58
4	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,725,300,000	130.55 2,252,403,304	130.41 2,250,119,007	5.625 2042/4/4	1.57
5	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,598,778,000	124.25 1,986,540,325	124.52 1,990,894,292	6.05 2040/1/11	1.39
6	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,725,300,000	112.31 1,937,817,278	111.25 1,919,508,394	4.5 2029/4/22	1.34
7	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,840,320,000	100.85 1,855,981,698	99.80 1,836,657,763	2.783 2031/1/23	1.28
8	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,656,288,000	113.06 1,872,686,628	110.31 1,827,077,793	4.375 2029/3/21	1.28
9	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,840,320,000	96.74 1,780,347,421	97.02 1,785,570,480	3.875 2030/6/12	1.25
10	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,702,296,000	105.81 1,801,331,095	104.20 1,773,937,127	4.625 2028/1/13	1.24

11	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,610,280,000	106.30 1,711,755,244	106.12 1,708,829,136	4.6 2046/1/23	1.19
12	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	1,035,180,000	165.39 1,712,085,352	163.64 1,694,022,381	7.625 2041/3/29	1.18
13	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 メキシコ	国債証券	1,495,260,000	113.56 1,698,144,353	113.15 1,691,886,690	4.75 2032/4/27	1.18
14	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,541,268,000	110.73 1,706,787,531	108.32 1,669,540,029	4.25 2027/6/23	1.17
15	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,840,320,000	98.76 1,817,539,713	90.37 1,663,189,200	5 2045/6/15	1.16
16	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,541,268,000	107.02 1,649,581,183	105.47 1,625,629,303	4.875 2023/9/16	1.14
17	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,495,260,000	110.35 1,650,034,362	108.55 1,623,163,045	5.75 2023/11/22	1.13
18	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,426,248,000	110.82 1,580,628,994	109.71 1,564,799,435	6 2024/1/26	1.09
19	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証券	1,610,280,000	97.64 1,572,283,143	96.68 1,556,867,012	2.659 2031/5/24	1.09
20	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,403,244,000	111.69 1,567,306,687	110.56 1,551,461,647	5.875 2025/9/16	1.08
21	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,423,947,600	110.26 1,570,072,458	108.76 1,548,721,008	5.375 2024/3/25	1.08
22	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,495,260,000	102.90 1,538,755,963	103.23 1,543,692,966	4.85 2029/9/30	1.08
23	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	977,670,000	151.19 1,478,219,211	152.47 1,490,663,030	7.75 2038/1/17	1.04
24	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,587,276,000	94.62 1,501,970,956	93.10 1,477,753,956	5 2045/1/27	1.03
25	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,035,180,000	138.09 1,429,531,245	140.75 1,457,026,201	5.625 2050/11/18	1.02
26	PANAMA 4.5 04/16/50 パナマ	国債証券	1,299,726,000	111.06 1,443,554,369	110.05 1,430,348,463	4.5 2050/4/16	1.00
27	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証券	1,610,280,000	92.15 1,483,921,903	88.82 1,430,347,312	4.75 2050/1/14	1.00
28	SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28 南アフリカ	国債証券	1,403,244,000	100.99 1,417,254,126	101.43 1,423,415,632	4.3 2028/10/12	0.99
29	PANAMA 4.5 04/01/56 パナマ	国債証券	1,265,220,000	110.81 1,402,103,001	110.47 1,397,751,795	4.5 2056/4/1	0.98
30	BRAZIL 6.0 04/07/26 ブラジル	国債証券	1,242,216,000	114.14 1,417,914,455	112.21 1,393,934,051	6 2026/4/7	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

2021年12月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.65
合計	97.65

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2021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 Mar22	買建	592	16,078,328,057	16,289,270,424	2.17
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar22	買建	580	3,195,084,806	3,229,182,828	0.43
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar22	買建	81	913,661,139	926,170,378	0.12
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar22	買建	31	708,034,762	719,693,321	0.10

シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Mar22	買建	19	288,716,620	293,815,667	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

2021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-US	MINI MSCI EMG MKT Mar22	買建	1,234	8,739,099,404	8,651,628,419	12.49

(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(2021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
第9計算期間末 (2021年6月11日)	9,706	9,706	1.1869	1.1869

第10計算期間末 (2021年12月13日)	8,589	8,589	1.1896	1.1896
2020年12月末日	10,350	-	1.1546	-
2021年1月末日	10,168	-	1.1625	-
2月末日	9,977	-	1.1502	-
3月末日	9,722	-	1.1465	-
4月末日	9,720	-	1.1687	-
5月末日	9,620	-	1.1719	-
6月末日	9,578	-	1.1848	-
7月末日	9,331	-	1.1916	-
8月末日	9,172	-	1.1974	-
9月末日	8,874	-	1.1682	-
10月末日	8,922	-	1.1873	-
11月末日	8,625	-	1.1805	-
12月末日	8,446	-	1.1872	-

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

直近日(2021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
第9計算期間末 (2021年6月11日)	30,943	30,943	1.0971	1.0971
第10計算期間末 (2021年12月13日)	26,061	26,061	1.0983	1.0983
2020年12月末日	35,307	-	1.0722	-
2021年1月末日	34,172	-	1.0770	-
2月末日	32,893	-	1.0645	-
3月末日	32,041	-	1.0612	-
4月末日	31,869	-	1.0804	-
5月末日	30,912	-	1.0833	-
6月末日	30,315	-	1.0951	-
7月末日	29,589	-	1.1016	-

8月末日	29,195	-	1.1071	-
9月末日	27,525	-	1.0799	-
10月末日	27,178	-	1.0975	-
11月末日	26,159	-	1.0911	-
12月末日	25,699	-	1.0960	-

【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
第9計算期間	0.0000
第10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
第9計算期間	0.0000
第10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
第9計算期間	3.3
第10計算期間	0.2

(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
第9計算期間	2.7
第10計算期間	0.1

(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
第9計算期間	227,608,795	1,163,074,115
第10計算期間	159,562,024	1,117,350,709

(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
第9計算期間	107,132,818	5,624,497,695
第10計算期間	92,831,691	4,569,076,002

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

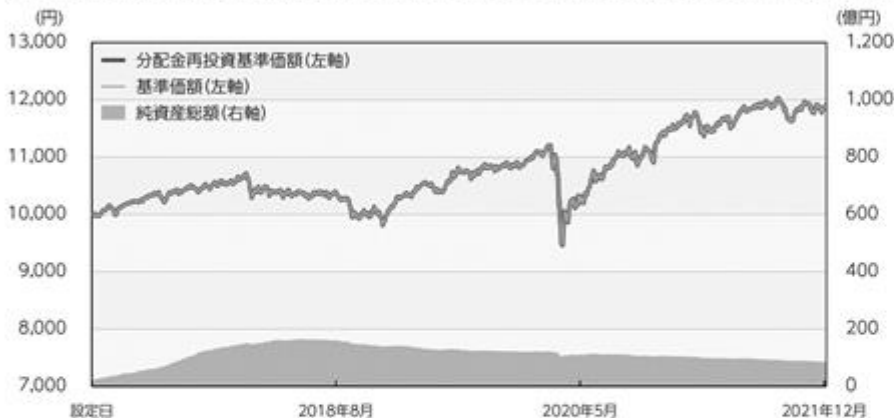
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2021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~2021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)

年月	分配金 (円)
2019年12月	0円
2020年6月	0円
2020年12月	0円
2021年6月	0円
2021年12月	0円
設定来累計	0円

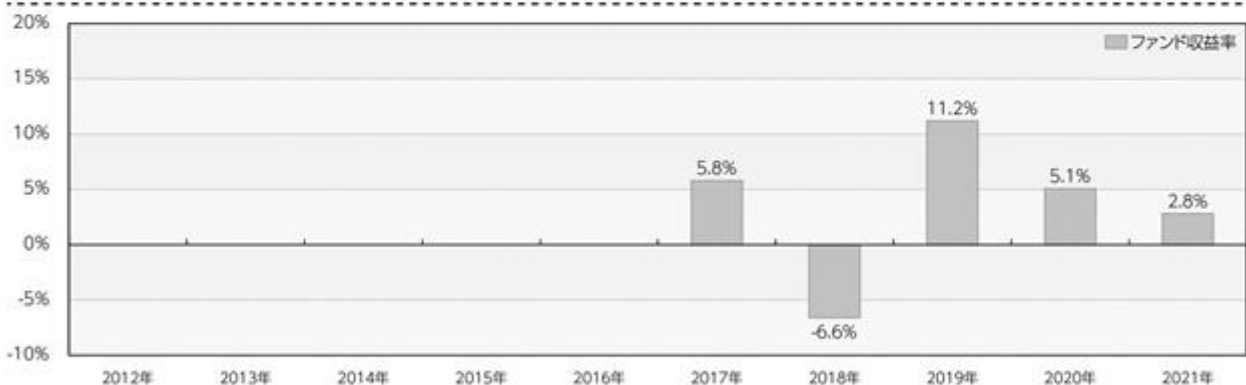
※分配金は1万口当たりです。

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	44.20
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	15.24
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	15.00
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	14.18
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	10.31
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.48

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:2021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～2021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)

2019年12月	0円
2020年6月	0円
2020年12月	0円
2021年6月	0円
2021年12月	0円
設定来累計	0円

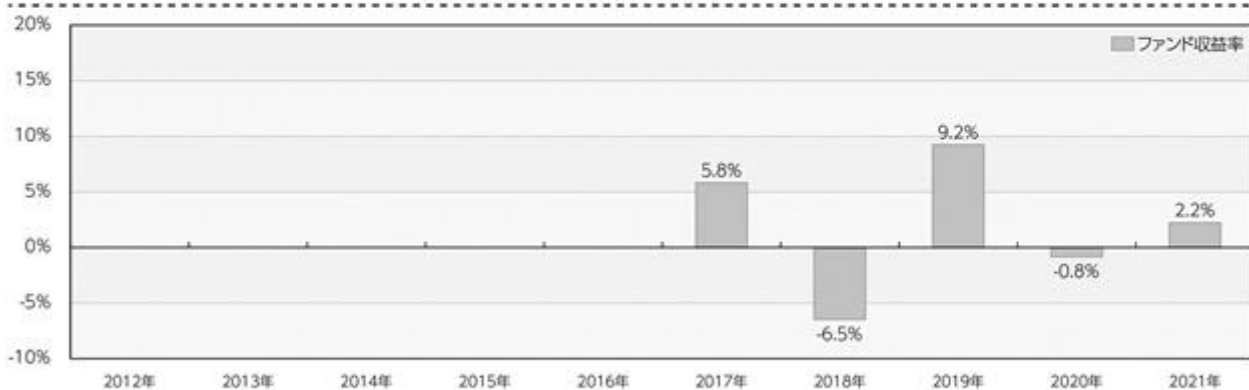
※分配金は1万口当たりです。

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	38.38
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	13.39
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	13.10
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	12.67
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	9.14
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.24

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:2021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	4.95
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.08
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.58
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.53
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.47

■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 0.125 08/31/23	国債証券	アメリカ	0.125	2023/8/31	0.72
2	US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	アメリカ	1.375	2023/9/30	0.64
3	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.61
4	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.57
5	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.56

■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	7.34
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.49
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.37
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.09
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.95

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	6.23
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.75
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.62
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	2.45
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.28

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年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	2.75
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.90
3	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	ロシア	4.75	2026/5/27	1.58
4	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.57
5	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.05	2040/1/11	1.39

○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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

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します。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位としします。

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】

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

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

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

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

ロ. 信託約款の変更等

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

ハ. 関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、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)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、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10期計算期間(2021年6月12日から2021年12月13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9期 2021年6月11日現在	第10期 2021年12月13日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,340,915	3,782,198
コール・ローン	246,722,644	173,820,751
投資信託受益証券	42,790,858	40,835,279
親投資信託受益証券	9,478,428,496	8,454,626,749
派生商品評価勘定	1,489,842	160,457
未収入金	22,130	-
流動資産合計	9,772,794,885	8,673,225,434
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,962,141	13,942,516
未払金	45,855	-
未払解約金	568,273	12,555,980
未払受託者報酬	1,641,017	1,523,800
未払委託者報酬	60,172,380	55,874,389
その他未払費用	194,651	180,744
流動負債合計	66,584,317	84,077,429
純資産の部		
元本等		
元本	8,177,759,568	7,219,970,883
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,528,451,000	1,369,177,122
（分配準備積立金）	1,205,461,067	1,078,854,044
元本等合計	9,706,210,568	8,589,148,005
純資産合計	9,706,210,568	8,589,148,005
負債純資産合計	9,772,794,885	8,673,225,434

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期 自 2020年12月12日 至 2021年6月11日	第10期 自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
営業収益		
受取配当金	488,115	316,109
受取利息	251	274
有価証券売買等損益	699,526,654	220,139,873
為替差損益	314,473,991	141,718,396
営業収益合計	385,541,029	78,737,860
営業費用		
支払利息	16,886	22,621
受託者報酬	1,641,017	1,523,800
委託者報酬	60,172,380	55,874,389
その他費用	833,805	1,156,872
営業費用合計	62,664,088	58,577,682
営業利益又は営業損失()	322,876,941	20,160,178
経常利益又は経常損失()	322,876,941	20,160,178
当期純利益又は当期純損失()	322,876,941	20,160,178
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()	12,011,727	311,539
期首剰余金又は期首欠損金()	1,354,336,153	1,528,451,000
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,244,353	29,710,623
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	36,244,353	29,710,623
剰余金減少額又は欠損金増加額	172,994,720	208,833,140
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	172,994,720	208,833,140
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()	1,528,451,000	1,369,177,122

(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10期	
	自 2021年6月12日	至 2021年12月13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> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月11日及び12月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2021年12月13日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期	第10期
	2021年6月11日現在	2021年12月13日現在
1. 期首元本額	9,113,224,888円	8,177,759,568円
期中追加設定元本額	227,608,795円	159,562,024円
期中一部解約元本額	1,163,074,115円	1,117,350,709円
2. 受益権の総数	8,177,759,568口	7,219,970,883口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期	第10期
	自 2020年12月12日 至 2021年6月11日	自 2021年6月12日 至 2021年12月13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(86,429,139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(224,436,075円)、信託約款に規定される収益調整金(322,989,933円)及び分配準備積立金(894,595,853円)より分配対象収益は1,528,451,000円(1万口当たり1,869.03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(36,412,359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(290,323,078円)及び分配準備積立金(1,042,441,685円)より分配対象収益は1,369,177,122円(1万口当たり1,896.37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9期 自 2020年12月12日 至 2021年6月11日	第10期 自 2021年6月12日 至 2021年12月13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9期	第10期
	2021年6月11日現在	2021年12月13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9期	第10期
	2021年6月11日現在	2021年12月13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	3,090,702	3,558,380
親投資信託受益証券	587,822,631	191,507,662
合計	590,913,333	187,949,282

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第9期			
	2021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	5,162,196,678	-	5,164,668,977	2,472,299
アメリカ・ドル	4,173,566,832	-	4,176,031,968	2,465,136
イギリス・ポンド	127,607,580	-	127,187,330	420,250
イスラエル・シェケル	2,354,803	-	2,361,506	6,703
オーストラリア・ドル	101,691,360	-	101,796,000	104,640
カナダ・ドル	72,564,800	-	72,413,200	151,600
シンガポール・ドル	38,113,254	-	38,035,790	77,464
スイス・フラン	42,636,020	-	42,851,725	215,705
スウェーデン・クローナ	16,482,125	-	16,587,500	105,375
デンマーク・クローネ	11,333,511	-	11,294,892	38,619
ニュージーランド・ドル	4,774,368	-	4,721,088	53,280
ノルウェー・クローネ	2,895,640	-	2,910,600	14,960
メキシコ・ペソ	22,194,802	-	22,491,994	297,192
ユーロ	204,751,485	-	204,002,856	748,629
香港・ドル	292,875,398	-	293,031,248	155,850
南アフリカ・ランド	48,354,700	-	48,951,280	596,580
合計	5,162,196,678	-	5,164,668,977	2,472,299

種類	第10期			
	2021年12月13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	4,587,953,765	-	4,601,735,824	13,782,059
アメリカ・ドル	3,758,975,880	-	3,770,287,290	11,311,410
イギリス・ポンド	102,423,640	-	102,348,568	75,072
イスラエル・シェケル	2,164,560	-	2,196,648	32,088
オーストラリア・ドル	81,600,122	-	82,185,013	584,891
カナダ・ドル	60,287,508	-	60,697,684	410,176
シンガポール・ドル	29,848,716	-	29,960,820	112,104
スイス・フラン	36,965,340	-	36,982,830	17,490
スウェーデン・クローナ	13,573,980	-	13,532,400	41,580
デンマーク・クローネ	9,837,003	-	9,843,900	6,897
ニュージーランド・ドル	3,861,075	-	3,857,260	3,815
ノルウェー・クローネ	2,250,360	-	2,282,508	32,148
メキシコ・ペソ	19,749,899	-	20,384,013	634,114
ユーロ	161,765,730	-	161,855,568	89,838
香港・ドル	271,675,872	-	272,387,232	711,360
南アフリカ・ランド	32,974,080	-	32,934,090	39,990
合計	4,587,953,765	-	4,601,735,824	13,782,059

(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9期 2021年6月11日現在	第10期 2021年12月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1869円 (11,869円)	1.1896円 (11,896円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年12月13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	359,592.100	
	アメリカ・ドル	小計	13,300.000	359,592.100 (40,835,279)	
投資信託受益証券 合計			13,300	40,835,279 (40,835,279)	
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	217,876,394	1,287,889,152	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	503,303,736	853,955,448	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,645,148,637	3,826,736,533	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	833,770,619	1,202,880,872	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	578,002,137	1,283,164,744		
日本円 小計			4,778,101,523	8,454,626,749	
親投資信託受益証券 合計			4,778,101,523	8,454,626,749	
合計				8,495,462,028	

(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	0.48	0.48

(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9期 2021年6月11日現在	第10期 2021年12月13日現在
資産の部		
流動資産		
預金	4,822,280	5,490,318
コール・ローン	699,744,679	2,683,660,809
投資信託受益証券	65,955,834	62,941,595
親投資信託受益証券	30,481,022,519	23,601,128,788
派生商品評価勘定	4,796,310	468,560
未収入金	66,390	-
流動資産合計	31,256,408,012	26,353,690,070
資産合計	31,256,408,012	26,353,690,070
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,708,993	39,143,965
未払金	103,954	-
未払解約金	95,111,002	73,427,720
未払受託者報酬	5,439,902	4,762,152
未払委託者報酬	199,465,219	174,613,780
その他未払費用	517,939	480,945
流動負債合計	313,347,009	292,428,562
負債合計	313,347,009	292,428,562
純資産の部		
元本等		
元本	28,204,299,614	23,728,055,303
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,738,761,389	2,333,206,205
(分配準備積立金)	1,714,593,021	1,545,058,727
元本等合計	30,943,061,003	26,061,261,508
純資産合計	30,943,061,003	26,061,261,508
負債純資産合計	31,256,408,012	26,353,690,070

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期 自 2020年12月12日 至 2021年6月11日	第10期 自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
営業収益		
受取配当金	752,358	487,235
受取利息	2,799,699	652
有価証券売買等損益	1,975,950,624	645,621,548
為替差損益	930,208,347	437,334,312
営業収益合計	1,049,294,334	208,775,123
営業費用		
支払利息	316,908	61,052
受託者報酬	5,439,902	4,762,152
委託者報酬	199,465,219	174,613,780
その他費用	1,377,204	1,546,558
営業費用合計	206,599,233	180,983,542
営業利益又は営業損失()	842,695,101	27,791,581
経常利益又は経常損失()	842,695,101	27,791,581
当期純利益又は当期純損失()	842,695,101	27,791,581
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()	37,108,668	1,351,237
期首剰余金又は期首欠損金()	2,310,564,520	2,738,761,389
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,061,260	8,975,804
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	8,061,260	8,975,804
剰余金減少額又は欠損金増加額	385,450,824	443,673,806
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	385,450,824	443,673,806
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()	2,738,761,389	2,333,206,205

(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10期	
	自 2021年6月12日	至 2021年12月13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> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月11日及び12月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2021年12月13日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期	第10期
	2021年6月11日現在	2021年12月13日現在
1. 期首元本額	33,721,664,491円	28,204,299,614円
期中追加設定元本額	107,132,818円	92,831,691円
期中一部解約元本額	5,624,497,695円	4,569,076,002円
2. 受益権の総数	28,204,299,614口	23,728,055,303口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期	第10期
	自 2020年12月12日 至 2021年6月11日	自 2021年6月12日 至 2021年12月13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(242,775,763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(1,024,168,368円)及び分配準備積立金(1,471,817,258円)より分配対象収益は2,738,761,389円(1万口当たり971.04円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(107,858,911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(788,147,478円)及び分配準備積立金(1,437,199,816円)より分配対象収益は2,333,206,205円(1万口当たり983.31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9期 自 2020年12月12日 至 2021年6月11日	第10期 自 2021年6月12日 至 2021年12月13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9期	第10期
	2021年6月11日現在	2021年12月13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9期	第10期
	2021年6月11日現在	2021年12月13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	4,763,863	5,484,721
親投資信託受益証券	1,655,273,059	516,654,769
合計	1,660,036,922	511,170,048

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第9期			
	2021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				
アメリカ・ドル	16,525,978,622	-	16,533,891,305	7,912,683
イギリス・ポンド	13,340,976,996	-	13,348,856,904	7,879,908
イスラエル・シケル	409,277,970	-	407,930,095	1,347,875
オーストラリア・ドル	7,064,411	-	7,084,518	20,107
カナダ・ドル	327,107,208	-	327,443,800	336,592
シンガポール・ドル	231,300,300	-	230,817,075	483,225
シンガポール・ドル	121,796,703	-	121,549,155	247,548
スイス・フラン	136,435,264	-	137,125,520	690,256
スウェーデン・クローナ	52,874,657	-	53,212,700	338,043
デンマーク・クローネ	36,339,194	-	36,215,368	123,826
ニュージーランド・ドル	16,710,288	-	16,523,808	186,480
ノルウェー・クローネ	9,081,780	-	9,128,700	46,920
メキシコ・ペソ	71,832,438	-	72,794,286	961,848
ユーロ	658,416,540	-	656,009,184	2,407,356
香港・ドル	950,365,163	-	950,870,888	505,725
南アフリカ・ランド	156,399,710	-	158,329,304	1,929,594
合計	16,525,978,622	-	16,533,891,305	7,912,683

種類	第10期			
	2021年12月13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				
アメリカ・ドル	12,845,133,863	-	12,883,809,268	38,675,405
イギリス・ポンド	10,475,797,320	-	10,507,320,810	31,523,490
イスラエル・シケル	283,171,240	-	282,963,688	207,552
オーストラリア・ドル	6,493,680	-	6,589,944	96,264
カナダ・ドル	225,410,238	-	227,025,927	1,615,689
シンガポール・ドル	164,904,066	-	166,026,018	1,121,952
シンガポール・ドル	92,033,541	-	92,379,195	345,654
スイス・フラン	112,128,198	-	112,181,251	53,053
スウェーデン・クローナ	41,098,995	-	40,973,100	125,895
デンマーク・クローネ	29,683,588	-	29,704,400	20,812
ニュージーランド・ドル	11,583,225	-	11,571,780	11,445
ノルウェー・クローネ	6,876,100	-	6,974,330	98,230
メキシコ・ペソ	61,030,855	-	62,990,385	1,959,530
ユーロ	445,497,685	-	445,745,096	247,411
香港・ドル	787,453,676	-	789,515,556	2,061,880
南アフリカ・ランド	101,971,456	-	101,847,788	123,668
合計	12,845,133,863	-	12,883,809,268	38,675,405

(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9期 2021年6月11日現在	第10期 2021年12月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0971円 (10,971円)	1.0983円 (10,983円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年12月13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	20,500.000	554,258.500	
	アメリカ・ドル	小計	20,500.000	554,258.500 (62,941,595)	
投資信託受益証券 合計			20,500	62,941,595 (62,941,595)	
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	598,538,455	3,538,020,661	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,388,123,215	2,355,228,658	
		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	7,351,742,584	10,635,765,996	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2,426,877,897	3,501,256,742	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,608,494,023	3,570,856,731	
日本円 小計			13,373,776,174	23,601,128,788	
親投資信託受益証券 合計			13,373,776,174	23,601,128,788	
合計				23,664,070,383	

(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	0.24	0.27

(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)

2021年12月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	38,892,653,731
コール・ローン	364,232,673
株式	642,600,793,560
投資信託受益証券	1,168,694,024
投資証券	13,975,097,006
派生商品評価勘定	75,996,415
未収入金	3,908,858
未収配当金	700,519,167
差入委託証拠金	4,503,702,337
流動資産合計	702,285,597,771
資産合計	702,285,597,771
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,961,841
未払金	31,963,728,472
未払解約金	48,750,000
流動負債合計	32,031,440,313
負債合計	32,031,440,313
純資産の部	
元本等	
元本	113,388,316,058
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	556,865,841,400
元本等合計	670,254,157,458
純資産合計	670,254,157,458
負債純資産合計	702,285,597,771

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年12月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	104,842,284,348円
同期中追加設定元本額	52,849,102,495円
同期中一部解約元本額	44,303,070,785円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,297,580,192円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,385,874円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	11,380,092円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	32,075,416円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,013,924円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,064,799円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,820,614円
たわらノーロード 先進国株式	27,533,684,343円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	351,892,713円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,719,873,140円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	543,504,673円
たわらノーロード バランス(堅実型)	62,409,528円
たわらノーロード バランス(標準型)	509,653,596円
たわらノーロード バランス(積極型)	622,957,826円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	915,567円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	137,117,579円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	395,237,421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)	291,874,090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)	443,762,876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)	887,341円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	14,074,181円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,823,746円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	9,569,901円
たわらノーロード 全世界株式	189,305,432円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	50,236,791,175円
One DC 先進国株式インデックスファンド	1,662,015,748円
Oneグローバルバランス	1,590,627円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	151,741,851円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	771,444,800円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,007,158,742円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	92,526,778円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	274,696,866円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	247,534,529円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,636,202円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	684,240,933円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	132,720,655円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	169,805,775円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,448,552円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	296,794,402円
投資のソムリエ	5,993,620,683円
クルーズコントロール	117,504,519円
投資のソムリエ<DC年金>	306,711,006円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	174,469,339円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	133,231,418円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	459,524円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,501,807円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	221,753,426円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,001,992,688円
ワールドアセットバランス(基本コース)	217,876,394円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	598,538,455円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	25,877,347円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	13,704,174円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,263,925円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	61,696,103円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	92,921,258円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,702,357,170円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	158,467,147円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	20,413,829円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,388,111円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,633,914円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	24,009,393円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	457,184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)	827,245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)	784,505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)	10,539,464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)	574,504円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	812,556円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04(適格機関投資家限定)	3,781,657円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	112,981,463円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	776,833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)	982,907,698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)	63,415,178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)	1,192,931,559円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,190,616,725円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,072,341,652円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	161,780,504円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	8,077,681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)	1,328,437円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,311,824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)	32,108,695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)	55,513,977円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,277,932円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	22,803,658円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,005,715円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	485,178円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	4,294,892円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	28,223,336円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	207,441,354円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	308,153,209円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,008,551,981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)	88,525,699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)	52,289,380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)	336,972,292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)	13,616,661円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,491,895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)	130,796,575円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	11,508,439円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	39,930,362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)	63,677,674円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	135,994,909円
計	113,388,316,058円
2. 受益権の総数	113,388,316,058口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年12月13日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	63,914,621,441	
投資信託受益証券	128,445,476	
投資証券	2,078,047,212	
合計	66,121,114,129	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年2月16日から2021年12月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年12月13日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
買建					
アメリカ・ドル	632,599,635	-	632,584,550		15,085
イギリス・ポンド	486,942,278	-	486,925,984		16,294
オーストラリア・ドル	28,603,930	-	28,604,006		76
カナダ・ドル	11,882,648	-	11,882,750		102
ユーロ	16,694,911	-	16,695,116		205
	88,475,868	-	88,476,694		826
合計	632,599,635	-	632,584,550		15,085

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2021年12月13日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	12,823,696,560	-	12,880,746,219	57,049,659
合計	12,823,696,560	-	12,880,746,219	57,049,659

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2021年12月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.9111円 (59,111円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2021年12月13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	45,800	3,444.240	157,746,192.000	
	ABBOTT LABORATORIES	178,034	134.370	23,922,428.580	
	AES CORP	65,452	24.420	1,598,337.840	
	ABIOMED INC	4,195	306.030	1,283,795.850	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	90,087	124.090	11,178,895.830	
	ADVANCED MICRO DEVICES	121,934	138.550	16,893,955.700	
	ADOBE INC	47,933	654.450	31,369,751.850	
	CHUBB LTD	44,175	191.470	8,458,187.250	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22,388	295.350	6,612,295.800	
	ALLEGHANY CORP	1,577	675.800	1,065,736.600	
	ALLSTATE CORP	28,370	108.020	3,064,527.400	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	69,367	209.810	14,553,890.270	
	AMGEN INC	57,357	210.890	12,096,017.730	
	HESS CORP	28,694	79.160	2,271,417.040	
	AMERICAN EXPRESS CO	67,984	167.030	11,355,367.520	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	50,332	83.990	4,227,384.680	

AFLAC INC	61,408	57.840	3,551,838.720	
AMERICAN INTL GROUP	83,524	54.390	4,542,870.360	
AMERCO	929	705.110	655,047.190	
ANALOG DEVICES	53,839	183.430	9,875,687.770	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	72,103	79.320	5,719,209.960	
VALERO ENERGY CORP	41,615	70.850	2,948,422.750	
ANSYS INC	8,668	398.450	3,453,764.600	
APPLE INC	1,660,945	179.450	298,056,580.250	
APPLIED MATERIALS INC	90,899	152.730	13,883,004.270	
ALBEMARLE CORP	11,175	262.870	2,937,572.250	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,810	63.450	3,477,694.500	
AMEREN CORP	25,054	87.240	2,185,710.960	
ARROW ELECTRONICS INC	8,186	126.570	1,036,102.020	
AUTODESK INC	22,290	269.000	5,996,010.000	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	42,504	236.730	10,061,971.920	
AUTOZONE INC	2,179	2,003.020	4,364,580.580	
AVERY DENNISON CORP	7,898	212.630	1,679,351.740	
BALL CORP	31,294	93.500	2,925,989.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	133,022	288.230	38,340,931.060	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	82,722	56.730	4,692,819.060	
BAXTER INTERNATIONAL INC	50,612	80.860	4,092,486.320	
BECTON DICKINSON & CO	28,845	244.970	7,066,159.650	
AMETEK INC	23,606	142.750	3,369,756.500	
VERIZON COMM INC	417,409	50.190	20,949,757.710	
WR BERKLEY CORP	13,045	80.940	1,055,862.300	
BEST BUY CO INC	21,303	103.820	2,211,677.460	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,324	746.050	1,733,820.200	
YUM! BRANDS INC	28,476	133.870	3,812,082.120	
FIRSTENERGY CORP	53,250	39.620	2,109,765.000	
BOEING CO	56,191	205.060	11,522,526.460	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	109.550	1,231,122.900	
BORGWARNER INC	21,938	46.070	1,010,683.660	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	143,923	41.170	5,925,309.910	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,046	104.700	1,261,216.200	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,033	165.600	1,992,664.800	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,368	1,588.370	3,761,260.160	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	223,776	56.360	12,612,015.360	
ONEOK INC	45,072	62.000	2,794,464.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	138.020	1,027,420.880	

UNITED RENTALS INC	7,229	347.810	2,514,318.490	
SEMPRA ENERGY	32,320	126.790	4,097,852.800	
FEDEX CORP	25,582	246.280	6,300,334.960	
VERISIGN INC	10,340	244.700	2,530,198.000	
AMPHENOL CORP	60,806	84.270	5,124,121.620	
BROWN-FORMAN CORP	29,597	71.270	2,109,378.190	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.280	610,014.080	
CSX CORP	227,289	36.740	8,350,597.860	
COTERRA ENERGY INC	78,516	20.910	1,641,769.560	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	43.150	877,412.100	
CONSTELLATION BRANDS INC	17,025	235.320	4,006,323.000	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	48.490	1,406,452.450	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	85,956	19.280	1,657,231.680	
CATERPILLAR INC	55,112	203.460	11,213,087.520	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,258	110.610	1,134,637.380	
CITRIX SYSTEMS INC	11,589	81.510	944,619.390	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	12.130	1,118,240.440	
CERNER CORP	30,373	74.370	2,258,840.010	
JPMORGAN CHASE & CO	300,408	159.820	48,011,206.560	
CHURCH & DWIGHT CO INC	25,189	95.650	2,409,327.850	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,567	116.380	1,695,307.460	
CINTAS CORP	9,345	458.450	4,284,215.250	
CISCO SYSTEMS INC	423,381	59.250	25,085,324.250	
CLOROX COMPANY	12,700	168.530	2,140,331.000	
COCA-COLA CO/THE	412,083	56.280	23,192,031.240	
COPART INC	21,656	149.210	3,231,291.760	
COGNEX CORP	16,685	76.260	1,272,398.100	
COLGATE-PALMOLIVE CO	81,114	79.470	6,446,129.580	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	28,129	160.810	4,523,424.490	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,440	302.980	1,648,211.200	
NRG ENERGY, INC.	21,197	38.860	823,715.420	
COMCAST CORP-CL A	461,668	48.450	22,367,814.600	
CONAGRA BRANDS INC	50,908	32.080	1,633,128.640	
CONSOLIDATED EDISON INC	35,663	82.610	2,946,120.430	
CMS ENERGY CORP	30,078	62.530	1,880,777.340	
COOPER COS INC	5,074	399.580	2,027,468.920	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,540	46.230	764,644.200	
CORNING INC	83,350	37.610	3,134,793.500	
SEALED AIR CORP	13,870	65.100	902,937.000	
HEICO CORP-CL A	7,477	129.100	965,280.700	
CUMMINS INC	14,724	218.100	3,211,304.400	
DR HORTON INC	34,743	109.650	3,809,569.950	
DANAHER CORP	64,655	317.490	20,527,315.950	
MOODY'S CORP	16,915	397.750	6,727,941.250	

COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	53,103	82.100	4,359,756.300	
TARGET CORP	49,056	238.180	11,684,158.080	
DEERE & CO	29,648	358.360	10,624,657.280	
MORGAN STANLEY	137,457	98.430	13,529,892.510	
REPUBLIC SERVICES INC	21,887	135.490	2,965,469.630	
COSTAR GROUP INC	40,107	78.240	3,137,971.680	
THE WALT DISNEY CO	183,006	152.710	27,946,846.260	
DOLLAR TREE INC	22,816	141.550	3,229,604.800	
DOVER CORP	13,706	171.360	2,348,660.160	
OMNICOM GROUP	21,323	70.910	1,512,013.930	
DTE ENERGY CO	18,647	116.220	2,167,154.340	
DUKE ENERGY CORP	77,028	101.510	7,819,112.280	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,337	151.810	2,024,689.970	
EBAY INC	63,121	66.890	4,222,163.690	
BANK OF AMERICA CORP	761,504	44.520	33,902,158.080	
CITIGROUP INC	204,195	60.710	12,396,678.450	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,786	117.300	1,734,397.800	
EATON CORP PLC	40,079	170.460	6,831,866.340	
CADENCE DESIGN SYS INC	27,140	184.140	4,997,559.600	
DISH NETWORK CORP	21,420	32.130	688,224.600	
ECOLAB INC	26,254	232.010	6,091,190.540	
PERKINELMER INC	11,565	187.780	2,171,675.700	
ELECTRONIC ARTS INC	28,937	125.640	3,635,644.680	
SALESFORCE.COM INC	98,484	266.030	26,199,698.520	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	193.890	434,895.270	
EMERSON ELECTRIC CO	60,475	92.590	5,599,380.250	
ATMOS ENERGY CORP	13,760	95.740	1,317,382.400	
ENTERGY CORP	20,713	107.410	2,224,783.330	
EOG RESOURCES INC	58,986	89.680	5,289,864.480	
EQUIFAX INC	12,330	295.120	3,638,829.600	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	23,464	361.390	8,479,654.960	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	17,654	131.010	2,312,850.540	
EXXON MOBIL CORP	424,741	63.010	26,762,930.410	
FMC CORP	11,974	108.170	1,295,227.580	
NEXTERA ENERGY INC	196,703	90.280	17,758,346.840	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,874	466.070	1,805,555.180	
FAIR ISAAC CORP	2,810	407.490	1,145,046.900	
ASSURANT INC	5,523	155.000	856,065.000	
FASTENAL CO	56,454	64.100	3,618,701.400	
FIFTH THIRD BANCORP	70,745	43.760	3,095,801.200	
M&T BANK CORP	13,537	152.210	2,060,466.770	
FISERV INC	60,303	103.190	6,222,666.570	
FORD MOTOR CO	395,870	21.450	8,491,411.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	34.050	909,611.700	
FREEMPORT-MCMORAN INC	148,633	38.370	5,703,048.210	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20,941	169.600	3,551,593.600	
DENTSPLY SIRONA INC	19,594	53.290	1,044,164.260	

GENERAL DYNAMICS CORP	23,917	204.930	4,901,310.810	
GENERAL MILLS INC	61,881	64.760	4,007,413.560	
GENUINE PARTS CO	15,024	134.830	2,025,685.920	
GILEAD SCIENCES INC	126,735	70.250	8,903,133.750	
GARTNER INC	8,564	321.990	2,757,522.360	
MCKESSON CORP	15,768	233.090	3,675,363.120	
NVIDIA CORP	251,207	301.980	75,859,489.860	
GENERAL ELECTRIC CO	110,641	96.950	10,726,644.950	
VW GRAINGER INC	4,584	513.670	2,354,663.280	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,923	55.280	1,709,423.440	
HALLIBURTON CO	84,523	23.930	2,022,635.390	
MONSTER BEVERAGE CORP	40,396	89.550	3,617,461.800	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,848	391.060	13,236,598.880	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	20,363	216.800	4,414,698.400	
HASBRO INC	11,996	100.820	1,209,436.720	
HENRY SCHEIN INC	14,358	75.680	1,086,613.440	
HEICO CORP	3,623	144.680	524,175.640	
HERSHEY FOODS CORP	14,989	186.510	2,795,598.390	
HP INC	121,730	36.430	4,434,623.900	
F5 INC	5,548	229.460	1,273,044.080	
CROWN HOLDINGS INC NPR	14,182	108.560	1,539,597.920	
JUNIPER NETWORKS INC	35,290	34.000	1,199,860.000	
HOLOGIC INC	24,690	74.750	1,845,577.500	
HOME DEPOT INC	106,043	415.400	44,050,262.200	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,315	84.890	1,639,650.350	
HORMEL FOODS CORP	27,050	46.000	1,244,300.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	61,105	27.870	1,702,996.350	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	331.740	1,134,882.540	
HUMANA INC	12,983	461.190	5,987,629.770	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,752	198.560	1,737,797.120	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	152,327	15.270	2,326,033.290	
BIOGEN INC	15,244	232.620	3,546,059.280	
IDEX CORP	7,369	236.290	1,741,221.010	
ILLINOIS TOOL WORKS	31,734	242.770	7,704,063.180	
INTUIT INC	27,477	677.950	18,628,032.150	
IDEXX LABORATORIES INC	8,610	607.900	5,234,019.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	24,140	202.690	4,892,936.600	
INTEL CORP	407,628	50.590	20,621,900.520	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	25,429	147.120	3,741,114.480	
INTERNATIONAL PAPER CO	35,544	45.890	1,631,114.160	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	42,250	37.040	1,564,940.000	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	13,148	143.440	1,885,949.120	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,748	158.250	1,226,121.000	
INCYTE CORP	18,028	65.400	1,179,031.200	
JOHNSON & JOHNSON	264,339	165.490	43,745,461.110	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,528	68.150	2,421,233.200	
KLA CORPORATION	15,456	410.690	6,347,624.640	
DEVON ENERGY CORP	65,203	43.420	2,831,114.260	
KELLOGG CO	26,578	62.620	1,664,314.360	
KEYCORP	99,340	23.010	2,285,813.400	
KIMBERLY-CLARK CORP	34,216	136.070	4,655,771.120	
BLACKROCK INC/NEW YORK	15,256	925.160	14,114,240.960	
KROGER CO	72,562	44.600	3,236,265.200	
LAM RESEARCH CORP	14,326	705.960	10,113,582.960	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,384	435.370	1,908,662.080	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,881	128.170	1,138,277.770	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,625	113.010	1,765,781.250	
PLUG POWER INC	52,624	33.220	1,748,169.280	
LENNAR CORP	28,024	116.910	3,276,285.840	
ELI LILLY & CO	81,757	244.140	19,960,153.980	
BATH & BODY WORKS INC	26,967	76.470	2,062,166.490	
LINCOLN NATIONAL CORP	19,280	67.470	1,300,821.600	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	73,280	209.110	15,323,580.800	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,601	156.260	4,625,452.260	
LOCKHEED MARTIN CORP	25,086	344.880	8,651,659.680	
LOEWS CORP	22,394	57.100	1,278,697.400	
LOWE'S COS INC	69,598	261.380	18,191,525.240	
DOMINION ENERGY INC	79,399	75.960	6,031,148.040	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	34,959	41.410	1,447,652.190	
MCCORMICK & CO INC	25,214	90.510	2,282,119.140	
MCDONALD'S CORPORATION	75,000	264.970	19,872,750.000	
S&P GLOBAL INC	24,207	473.670	11,466,129.690	
EVEREST RE GROUP LTD	4,282	269.970	1,156,011.540	
MARKEL CORPORATION	1,447	1,241.780	1,796,855.660	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	62,947	121.840	7,669,462.480	
MARSH & MCLENNAN COS	50,755	171.800	8,719,709.000	
MASCO CORP	23,060	68.710	1,584,452.600	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	6,452	439.370	2,834,815.240	
METLIFE INC	71,098	60.630	4,310,671.740	
MEDTRONIC PLC	134,859	112.430	15,162,197.370	
ACTIVISION BLIZZARD INC	75,898	58.600	4,447,622.800	

CVS HEALTH CORP	132,558	98.860	13,104,683.880	
MERCK & CO. INC.	254,585	72.620	18,487,962.700	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	43,713	65.260	2,852,710.380	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,806	288.390	2,827,952.340	
MICROSOFT CORP	717,290	342.540	245,700,516.600	
MICRON TECH INC	113,316	85.540	9,693,050.640	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	55,395	87.130	4,826,566.350	
3M CO	58,089	177.100	10,287,561.900	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	178.380	1,063,679.940	
ENTEGRIS INC	13,639	146.890	2,003,432.710	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,253	357.740	1,879,208.220	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,477	264.920	4,365,086.840	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,248	298.640	2,463,182.720	
ILLUMINA INC	14,836	374.520	5,556,378.720	
XCEL ENERGY INC	54,502	66.510	3,624,928.020	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	79.650	773,640.450	
NETAPP INC	21,903	89.320	1,956,375.960	
NEWELL BRANDS INC	40,489	22.330	904,119.370	
NEWMONT CORP	81,573	56.100	4,576,245.300	
NOVAVAX INC	6,377	166.560	1,062,153.120	
NVR INC	343	5,935.720	2,035,951.960	
NIKE INC-CL B	128,584	169.060	21,738,411.040	
NORDSON CORP	4,892	270.670	1,324,117.640	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,920	289.530	7,215,087.600	
EVERSOURCE ENERGY	34,979	87.880	3,073,954.520	
NISOURCE INC	42,035	25.930	1,089,967.550	
NORTHERN TRUST CORP	20,276	118.350	2,399,664.600	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,351	371.060	5,696,142.060	
WELLS FARGO & CO	413,116	50.200	20,738,423.200	
NUCOR CORP	30,123	113.210	3,410,224.830	
CHENIERE ENERGY INC	24,574	103.040	2,532,104.960	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,107	150.410	6,784,543.870	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	95,129	30.770	2,927,119.330	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,444	356.290	3,364,802.760	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,771	682.370	4,620,327.270	
ORACLE CORP	168,417	102.630	17,284,636.710	
PACCAR INC	35,352	89.140	3,151,277.280	
PTC INC	11,092	120.570	1,337,362.440	
EXELON CORP	97,976	53.910	5,281,886.160	
PARKER HANNIFIN CORP	12,680	318.930	4,044,032.400	
PAYCHEX INC	32,693	124.250	4,062,105.250	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,577	668.120	5,062,345.240	

PPL CORPORATION	75,032	28.730	2,155,669.360	
PEPSICO INC	138,663	168.970	23,429,887.110	
PENTAIR PLC	16,339	75.220	1,229,019.580	
PFIZER INC	563,591	52.780	29,746,332.980	
ESSENTIAL UTILITIES INC	26,477	50.440	1,335,499.880	
CONOCOPHILLIPS	134,624	73.490	9,893,517.760	
PG&E CORP	152,496	12.350	1,883,325.600	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22,527	184.250	4,150,599.750	
ALTRIA GROUP INC	185,632	45.090	8,370,146.880	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	42,766	201.560	8,619,914.960	
BROWN & BROWN INC	24,969	67.210	1,678,166.490	
GARMIN LTD	14,761	136.110	2,009,119.710	
PPG INDUSTRIES INC	24,358	163.370	3,979,366.460	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	166.930	559,716.290	
COSTCO WHOLESALE CORP	44,451	558.820	24,840,107.820	
T ROWE PRICE GROUP INC	22,934	196.170	4,498,962.780	
QUEST DIAGNOSTICS	12,493	160.060	1,999,629.580	
PROCTER & GAMBLE CO	243,938	155.460	37,922,601.480	
PROGRESSIVE CORP	59,013	95.060	5,609,775.780	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	48,772	63.800	3,111,653.600	
PULTE GROUP INC	25,385	56.220	1,427,144.700	
GLOBAL PAYMENTS INC	29,968	125.800	3,769,974.400	
QUALCOMM INC	113,380	183.880	20,848,314.400	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,194	97.600	1,873,334.400	
EXACT SCIENCES CORP	17,982	79.300	1,425,972.600	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,665	669.520	7,140,430.800	
RESMED INC	14,735	261.380	3,851,434.300	
US BANCORP	142,211	57.770	8,215,529.470	
SEAGEN INC	12,791	142.570	1,823,612.870	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,809	43.430	1,685,474.870	
ROSS STORES INC	36,284	112.860	4,095,012.240	
ROLLINS INC	18,420	31.910	587,782.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,273	473.420	4,863,443.660	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,329	350.640	3,972,400.560	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	23,651	75.500	1,785,650.500	
RPM INTERNATIONAL INC	12,897	97.430	1,256,554.710	
ACCENTURE PLC-CL A	63,610	379.440	24,136,178.400	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	140,749	62.260	8,763,032.740	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,292	233.770	2,873,500.840	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	25,337	154.250	3,908,232.250	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	62,486	104.500	6,529,787.000	
BOOKING HOLDINGS INC	4,143	2,236.360	9,265,239.480	
SCHLUMBERGER LTD	136,982	30.990	4,245,072.180	
SCHWAB (CHARLES) CORP	145,487	80.810	11,756,804.470	
POOL CORP	4,110	562.670	2,312,573.700	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	21,516	124.490	2,678,526.840	
BUNGE LTD	13,581	86.910	1,180,324.710	
SEI INVESTMENTS CO	10,034	60.460	606,655.640	
ANTHEM INC	24,537	431.000	10,575,447.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,243	123.130	2,000,000.590	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	27,807	71.990	2,001,825.930	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	25,333	346.460	8,776,871.180	
CENTENE CORP	57,101	78.450	4,479,573.450	
SVB FINANCIAL GROUP	5,712	703.920	4,020,791.040	
SMITH (A.O.) CORP	14,037	83.630	1,173,914.310	
SNAP-ON INC	5,783	217.450	1,257,513.350	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,274	107.040	4,203,888.960	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	240.040	1,494,489.040	
EDISON INTERNATIONAL	38,678	67.060	2,593,746.680	
SOUTHERN CO	106,216	65.080	6,912,537.280	
TRUIST FINANCIAL CORP	134,617	59.390	7,994,903.630	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	41.970	554,843.400	
AT&T INC	720,190	22.840	16,449,139.600	
CHEVRON CORP	194,055	118.340	22,964,468.700	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,600	194.560	3,035,136.000	
STATE STREET CORP	36,224	93.510	3,387,306.240	
STARBUCKS CORP	118,687	116.730	13,854,333.510	
STEEL DYNAMICS INC	21,929	60.070	1,317,275.030	
STRYKER CORP	34,118	260.200	8,877,503.600	
NETFLIX INC	44,532	611.660	27,238,443.120	
NORTONLIFELOCK INC	55,388	24.320	1,347,036.160	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	60.960	968,471.520	
SYNOPSIS INC	14,947	362.340	5,415,895.980	
SYSCO CORP	52,112	73.670	3,839,091.040	
INTUITIVE SURGICAL INC	35,828	344.960	12,359,226.880	
TELEFLEX INC	4,875	321.290	1,566,288.750	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	8.340	882,013.380	
TERADYNE INC	15,699	159.760	2,508,072.240	
TEXAS INSTRUMENTS INC	92,553	196.000	18,140,388.000	
TEXTRON INC	23,288	75.410	1,756,148.080	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	39,576	642.510	25,427,975.760	

GLOBE LIFE INC	11,125	91.920	1,022,610.000	
DAVITA INC	6,497	105.810	687,447.570	
TRACTOR SUPPLY CO	11,492	234.310	2,692,690.520	
BIO-TECHNE CORP	4,057	466.040	1,890,724.280	
TRIMBLE INC	26,037	86.090	2,241,525.330	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,215	515.080	2,171,062.200	
TYSON FOODS INC	30,193	84.110	2,539,533.230	
UGI CORP	19,377	45.730	886,110.210	
UNION PACIFIC CORP	65,534	248.460	16,282,577.640	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	151,795	86.160	13,078,657.200	
UNITEDHEALTH GROUP INC	94,712	478.230	45,294,119.760	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	128.400	993,430.800	
VF CORP	34,457	75.980	2,618,042.860	
VIACOMCBS INC	62,426	31.220	1,948,939.720	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,421	208.060	5,289,093.260	
VULCAN MATERIALS CO	12,596	205.460	2,587,974.160	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	74,770	49.500	3,701,115.000	
WALMART INC	155,036	141.030	21,864,727.080	
WASTE MANAGEMENT INC	42,154	164.720	6,943,606.880	
WATERS CORP	6,368	340.960	2,171,233.280	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,590	431.570	3,275,616.300	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	11,399	132.880	1,514,699.120	
VAIL RESORTS INC	4,180	338.980	1,416,936.400	
WESTERN DIGITAL CORP	29,830	57.870	1,726,262.100	
WABTEC CORP	18,868	90.940	1,715,855.920	
WHIRLPOOL CORP	5,742	230.030	1,320,832.260	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,774	162.480	2,725,439.520	
WYNN RESORTS LTD	9,809	87.580	859,072.220	
NASDAQ INC	11,126	205.780	2,289,508.280	
CME GROUP INC	36,041	228.400	8,231,764.400	
WILLIAMS COS INC	122,786	26.640	3,271,019.040	
LKQ CORP	28,785	57.970	1,668,666.450	
ALLIANT ENERGY CORP	28,231	58.890	1,662,523.590	
WEC ENERGY GROUP INC	32,173	93.480	3,007,532.040	
CARMAX INC	16,604	149.480	2,481,965.920	
XILINX INC	24,939	217.180	5,416,252.020	
TJX COMPANIES INC	121,216	74.730	9,058,471.680	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,468	614.550	3,360,359.400	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	5.480	595,676.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	56.160	1,156,896.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,272	173.650	2,131,032.800	

SIGNATURE BANK	6,287	304.950	1,917,220.650	
CBRE GROUP INC	32,999	103.700	3,421,996.300	
LIBERTY GLOBAL PLC	14,597	27.880	406,964.360	
REGIONS FINANCIAL CORP	96,408	22.230	2,143,149.840	
DOMINO'S PIZZA INC	3,808	534.420	2,035,071.360	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,452	503.410	2,241,181.320	
T-MOBILE US INC	63,279	114.770	7,262,530.830	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,938	37.660	1,165,125.080	
MOSAIC CO/THE	38,515	36.740	1,415,041.100	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,959	385.840	1,527,540.560	
CELANESE CORP	11,436	160.920	1,840,281.120	
DEXCOM INC	9,767	566.500	5,533,005.500	
DISCOVERY INC-A	12,374	23.290	288,190.460	
EXPEDIA GROUP INC	14,724	166.950	2,458,171.800	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	23,823	61.170	1,457,252.910	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,844	297.810	3,229,451.640	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	27.970	951,623.310	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	56,496	135.540	7,657,467.840	
LIVE NATION	15,697	111.870	1,756,023.390	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,752	1,721.400	4,737,292.800	
TRANSDIGM GROUP INC	5,225	605.310	3,162,744.750	
MASTERCARD INC	88,623	349.920	31,010,960.160	
WESTERN UNION CO	44,868	18.210	817,046.280	
OWENS CORNING	9,740	92.650	902,411.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	88.100	1,133,494.600	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	10.220	177,317.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,948	178.360	1,952,685.280	
DELTA AIR LINES INC	14,723	38.180	562,124.140	
INSULET CORP	6,415	262.520	1,684,065.800	
DISCOVER FINANCIAL	30,494	116.770	3,560,784.380	
TE CONNECTIVITY LTD	31,927	160.360	5,119,813.720	
MASIMO CORP	5,404	277.350	1,498,799.400	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,984	409.580	4,908,406.720	
VMWARE INC	21,320	113.100	2,411,292.000	
MERCADOLIBRE INC	4,531	1,144.500	5,185,729.500	
ULTA BEAUTY INC	5,274	403.490	2,128,006.260	
INVESCO LTD	36,904	23.140	853,958.560	
MSCI INC	8,335	628.140	5,235,546.900	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	156,572	90.040	14,097,742.880	
VISA INC	169,662	213.400	36,205,870.800	
KEURIG DR PEPPER INC	72,662	35.320	2,566,421.840	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	18,404	176.140	3,241,680.560	
DISCOVERY INC-C	30,388	22.430	681,602.840	
MARATHON PETROLEUM CORP	64,661	63.690	4,118,259.090	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,486	105.680	1,425,200.480	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	206,334	16.160	3,334,357.440	
XYLEM INC	18,658	122.800	2,291,202.400	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	28,118	89.910	2,528,089.380	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,390	185.970	630,438.300	
SPLUNK INC	17,045	110.840	1,889,267.800	
EPAM SYSTEMS INC	5,785	697.120	4,032,839.200	
ZILLOW GROUP INC	7,658	59.100	452,587.800	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,728	69.650	1,234,755.200	
HCA HEALTHCARE INC	25,843	243.550	6,294,062.650	
VERISK ANALYTICS INC	15,492	226.660	3,511,416.720	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	122.720	754,973.440	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,356	222.810	1,638,990.360	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	17,972	208.660	3,750,037.520	
NXP SEMICONDUCTOR NV	26,729	226.460	6,053,049.340	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	83.430	1,141,906.410	
LEAR CORP	5,733	187.630	1,075,682.790	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	132.050	1,390,090.350	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	24,704	78.100	1,929,382.400	
DOLLAR GENERAL CORP	22,870	222.400	5,086,288.000	
FORTINET INC	14,060	332.630	4,676,777.800	
HORIZON PHARMA PLC	20,280	100.600	2,040,168.000	
TESLA INC	84,564	1,017.030	86,004,124.920	
GENERAC HOLDINGS INC	5,997	348.240	2,088,395.280	
ENPHASE ENERGY INC	12,203	215.020	2,623,889.060	
GENERAL MOTORS CO	131,922	63.210	8,338,789.620	
ALLY FINANCIAL INC	37,466	48.630	1,821,971.580	
APTIV PLC	26,425	168.970	4,465,032.250	
PHILLIPS 66	44,829	72.520	3,250,999.080	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	8,628	114.060	984,109.680	
META PLATFORMS INC	239,582	329.750	79,002,164.500	
IQVIA HOLDINGS INC	19,520	270.320	5,276,646.400	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,116	111.180	2,014,136.880	
SERVICENOW INC	19,988	647.000	12,932,236.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,473	531.850	5,038,215.050	
WORKDAY INC	19,327	279.680	5,405,375.360	

ABBVIE INC	177,867	125.470	22,316,972.490	
ZOETIS INC	47,727	231.450	11,046,414.150	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	21.860	838,811.920	
CDW CORP	14,207	194.870	2,768,518.090	
HOWMET AEROSPACE INC	40,434	30.860	1,247,793.240	
TWILIO INC	16,506	264.540	4,366,497.240	
COUPA SOFTWARE INC	7,732	155.490	1,202,248.680	
SNAP INC	107,179	50.820	5,446,836.780	
TRADE DESK INC A	42,396	94.060	3,987,767.760	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,557	60.520	1,123,069.640	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	48.540	404,046.960	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	15,995	48.290	772,398.550	
OKTA INC	12,809	223.660	2,864,860.940	
BLACK KNIGHT INC	16,775	73.750	1,237,156.250	
BAKER HUGHES CO	85,741	25.440	2,181,251.040	
BROADCOM INC	41,154	631.680	25,996,158.720	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	8,085	185.380	1,498,797.300	
MONGODB INC	5,833	507.730	2,961,589.090	
BURLINGTON STORES INC	6,861	289.200	1,984,201.200	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	27.970	1,131,358.530	
VEEVA SYSTEMS INC	14,047	265.790	3,733,552.130	
TWITTER INC	81,032	45.560	3,691,817.920	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	59.820	956,222.700	
EVERGY INC	22,104	66.940	1,479,641.760	
ALLEGION PLC	8,924	131.060	1,169,579.440	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	103.860	1,387,569.600	
STERIS PLC	10,186	229.790	2,340,640.940	
DOCUSIGN INC	20,056	144.480	2,897,690.880	
WIX.COM LTD	5,567	145.320	808,996.440	
DROPBOX INC	28,170	23.960	674,953.200	
KKR & CO INC	53,234	75.340	4,010,649.560	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	43.950	209,114.100	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	21,978	185.250	4,071,424.500	
MODERNA INC	34,576	257.060	8,888,106.560	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	28,537	146.130	4,170,111.810	
ARAMARK	20,857	35.810	746,889.170	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	46,735	27.440	1,282,408.400	
CIGNA CORP	34,393	214.940	7,392,431.420	
DELL TECHNOLOGIES INC	27,783	57.600	1,600,300.800	
DOW INC	72,833	54.680	3,982,508.440	
AMCOR PLC	161,822	11.600	1,877,135.200	
PINTEREST INC	51,912	37.260	1,934,241.120	
PELOTON INTERACTIVE INC	24,849	38.510	956,934.990	
FOX CORP-A	34,681	36.820	1,276,954.420	

FOX CORP-B	15,080	34.240	516,339.200	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	31,617	24.480	773,984.160	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	19,194	198.600	3,811,928.400	
CHEWY INC	9,068	51.760	469,359.680	
AVANTOR INC	54,446	39.350	2,142,450.100	
LYFT INC	23,024	39.510	909,678.240	
DYNATRACE INC	19,417	61.750	1,198,999.750	
CLOUDFLARE INC	23,973	140.480	3,367,727.040	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	95.270	941,839.220	
CARRIER GLOBAL CORP	83,484	55.510	4,634,196.840	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,235	86.080	3,549,508.800	
INMODE LTD	5,511	69.240	381,581.640	
UBER TECHNOLOGIES INC	124,073	36.670	4,549,756.910	
CORTEVA INC	70,823	47.960	3,396,671.080	
MATCH GROUP INC	26,697	130.340	3,479,686.980	
BILL.COM HOLDINGS INC	7,830	255.040	1,996,963.200	
BLACKSTONE INC	68,906	133.800	9,219,622.800	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	3,202	127.020	406,718.040	
CARLYLE GROUP INC	17,020	54.120	921,122.400	
10X GENOMICS INC	7,667	139.510	1,069,623.170	
DATADOG INC	19,439	174.560	3,393,271.840	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	20,924	103.910	2,174,212.840	
UPSTART HOLDINGS INC	2,080	160.750	334,360.000	
INGERSOLL RAND INC	41,753	59.590	2,488,061.270	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,250	419.720	2,203,530.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	17,712	114.660	2,030,857.920	
ASANA INC	7,134	67.910	484,469.940	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	139.470	748,535.490	
AON PLC	22,726	293.740	6,675,535.240	
SOFI TECHNOLOGIES INC	54,734	15.010	821,557.340	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	47.340	757,534.680	
COINBASE GLOBAL INC	3,976	255.760	1,016,901.760	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,204	114.680	1,055,514.720	
IAC/INTERACTIVECORP	6,983	130.160	908,907.280	
AIRBNB INC	23,812	180.420	4,296,161.040	
ZENDESK INC	11,915	100.570	1,198,291.550	
ROYALTY PHARMA PLC	35,564	37.770	1,343,252.280	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	23,577	63.750	1,503,033.750	
VIATRIS INC	124,858	12.700	1,585,696.600	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,814	88.980	1,941,009.720	
DRAFTKINGS INC	33,459	30.410	1,017,488.190	
SNOWFLAKE INC	21,211	371.240	7,874,371.640	
DOORDASH INC	10,922	158.000	1,725,676.000	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	31.480	287,853.120	
ARISTA NETWORKS INC	23,535	130.690	3,075,789.150	

PALANTIR TECHNOLOGIES INC	160,694	18.940	3,043,544.360	
IHS MARKIT LTD	36,688	132.800	4,872,166.400	
FNF GROUP	25,284	50.310	1,272,038.040	
MARVELL TECHNOLOGY INC	82,953	89.020	7,384,476.060	
ROBINHOOD MARKETS INC	19,872	20.130	400,023.360	
LUCID GROUP INC	42,136	37.660	1,586,841.760	
CATALENT INC	16,022	122.320	1,959,811.040	
SYNCHRONY FINANCIAL	58,414	47.870	2,796,278.180	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	43,256	47.400	2,050,334.400	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	152.870	528,471.590	
WAYFAIR INC	6,942	202.040	1,402,561.680	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	18,061	201.850	3,645,612.850	
HUBSPOT INC	4,403	723.290	3,184,645.870	
QORVO INC	11,107	159.230	1,768,567.610	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	147.330	357,275.250	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,061	149.280	2,248,306.080	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	5,031	309.090	1,555,031.790	
GODADDY INC	16,574	71.400	1,183,383.600	
KORNIT DIGITAL LTD	4,978	146.650	730,023.700	
ETSY INC	12,845	225.280	2,893,721.600	
TRANSUNION	19,208	116.420	2,236,195.360	
BLOCK INC	40,161	181.320	7,281,992.520	
DUPONT DE NEMOURS INC	53,562	80.040	4,287,102.480	
CARVANA CO	7,735	270.820	2,094,792.700	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	21,537	53.440	1,150,937.280	
TELADOC HEALTH INC	14,790	94.010	1,390,407.900	
WESTROCK CO	26,297	43.620	1,147,075.140	
KRAFT HEINZ CO	64,743	34.150	2,210,973.450	
NOVOCURE LTD	9,772	84.250	823,291.000	
FORTIVE CORP	34,914	75.160	2,624,136.240	
WASTE CONNECTIONS INC	26,402	132.680	3,503,017.360	
ALPHABET INC-CL A	30,233	2,960.030	89,490,586.990	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	135,429	15.210	2,059,875.090	
PAYPAL HOLDINGS INC	112,337	188.510	21,176,647.870	
SEA LTD ADR	14,002	237.940	3,331,635.880	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,115	32.350	1,297,720.250	
SUNRUN INC	16,213	42.300	685,809.900	
ZILLOW GROUP INC-C	15,665	60.230	943,502.950	
ALPHABET INC-CL C	28,971	2,973.500	86,145,268.500	
ZSCALER INC	7,780	305.750	2,378,735.000	
CABLE ONE INC	542	1,709.950	926,792.900	

	LINDE PLC	52,027	334.000	17,377,018.000	
	ATHENE HOLDING LTD	13,416	79.980	1,073,011.680	
	ROKU INC	11,943	229.250	2,737,932.750	
	AVALARA INC	8,515	143.750	1,224,031.250	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,051	610.890	7,972,725.390	
	VISTRA CORP	38,032	21.020	799,432.640	
アメリカ・ドル	小計	31,748,647		4,180,139,345.350 (474,696,624,058)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	13.710	483,428.310	
	ASHTAD GROUP	45,546	62.000	2,823,852.000	
	SEVERN TRENT PLC	27,110	29.250	792,967.500	
	BHP GROUP PLC	213,530	21.280	4,543,918.400	
	BARCLAYS PLC	1,678,366	1.825	3,063,017.950	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	97,947	7.354	720,302.230	
	BT GROUP PLC	864,218	1.784	1,541,764.910	
	BUNZL PLC	35,508	29.560	1,049,616.480	
	AVIVA PLC	406,481	3.925	1,595,437.920	
	CRODA INTERNATIONAL	13,101	104.100	1,363,814.100	
	DIAGEO PLC	234,582	39.480	9,261,297.360	
	SCHRODERS PLC	11,354	34.250	388,874.500	
	DCC PLC	10,684	56.840	607,278.560	
	NATIONAL GRID PLC	363,031	10.508	3,814,729.740	
	KINGFISHER PLC	211,460	3.329	703,950.340	
	BAE SYSTEMS PLC	304,731	5.500	1,676,020.500	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	219,190	27.590	6,047,452.100	
	HALMA PLC	40,467	31.350	1,268,640.450	
	NEXT PLC	13,140	82.500	1,084,050.000	
	IMPERIAL BRANDS PLC	91,865	15.855	1,456,519.570	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	20.450	390,738.150	
	ANGLO AMERICAN PLC	131,054	29.160	3,821,534.640	
	COMPASS GROUP PLC	182,185	15.245	2,777,410.320	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,057,882	4.386	9,025,870.450	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	616,482	2.928	1,805,059.290	
	UNILEVER PLC	260,868	40.155	10,475,154.540	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	11.210	759,073.940	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,985	19.440	621,788.400	
	PEARSON PLC	63,702	5.944	378,644.680	
	PERSIMMON PLC	33,688	28.090	946,295.920	
	PRUDENTIAL PLC	265,794	12.980	3,450,006.120	
	RIO TINTO PLC	113,320	47.540	5,387,232.800	
	VODAFONE GROUP PLC	2,862,160	1.132	3,239,965.120	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	72,173	61.700	4,453,074.100	

RELX PLC	194,283	24.020	4,666,677.660	
RENTOKIL INITIAL PLC	193,406	6.234	1,205,693.000	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	781,282	1.228	959,414.290	
NATWEST GROUP PLC	572,346	2.160	1,236,267.360	
ST JAMES'S PLACE PLC	60,179	16.085	967,979.210	
SSE PLC	98,645	16.325	1,610,379.620	
BP PLC	2,036,424	3.426	6,976,788.620	
SAGE GROUP PLC(THE)	113,303	8.244	934,069.930	
SMITHS GROUP PLC	35,235	15.000	528,525.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,648	160.700	1,229,033.600	
STANDARD CHARTERED PLC	279,471	4.248	1,187,192.800	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,964,630	0.463	3,224,623.690	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.675	580,879.950	
TESCO PLC	779,363	2.844	2,216,508.370	
3I GROUP PLC	101,975	13.925	1,420,001.870	
SMITH & NEPHEW PLC	80,926	12.310	996,199.060	
GLAXOSMITHKLINE PLC	505,938	16.120	8,155,720.560	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	33,484	67.420	2,257,491.280	
WPP PLC	125,001	10.950	1,368,760.950	
ASTRAZENECA PLC	155,844	81.930	12,768,298.920	
WHITBREAD PLC	18,594	28.980	538,854.120	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	57.120	921,859.680	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	18.200	705,504.800	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,501	46.420	998,076.420	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.752	503,236.220	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	30.880	620,286.560	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,559	47.190	498,279.210	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	414,822	16.598	6,885,215.550	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	369,875	16.556	6,123,650.500	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	22.130	399,092.420	
AVEVA GROUP PLC	10,408	32.650	339,821.200	
ABRDN PLC	206,313	2.365	487,930.240	
EXPERIAN PLC	93,283	36.200	3,376,844.600	
MONDI PLC	47,464	18.305	868,828.520	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	13.170	465,059.040	
OCADO GROUP PLC	44,914	15.850	711,886.900	
INFORMA PLC	151,566	5.024	761,467.580	
GLENCORE PLC	1,011,518	3.679	3,721,374.720	
ENTAIN PLC	58,126	16.330	949,197.580	
EVRAZ PLC	48,765	5.994	292,297.410	
COCA-COLA HBC AG	20,233	24.570	497,124.810	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	87,313	6.514	568,756.880	

	FERGUSON PLC	21,499	124.050	2,666,950.950	
	M&G PLC	259,117	1.941	502,946.090	
	JD SPORTS FASHION PLC	235,490	2.200	518,078.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	104,624	7.338	767,730.910	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	470,129	1.489	700,022.080	
イギリス・ポンド 小計		29,179,174		182,699,660.120 (27,505,433,831)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,359	30.680	3,140,374.120	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	143,645	31.020	4,455,867.900	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,198	493.600	1,084,932.800	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	19.700	2,012,039.800	
	ICL GROUP LTD	68,048	29.910	2,035,315.680	
	NICE LTD	6,060	950.800	5,761,848.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,784	114.700	1,925,124.800	
	AZRIELI GROUP	4,414	294.300	1,299,040.200	
イスラエル・シュケル 小計		445,642		21,714,543.300 (795,136,632)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	69.500	1,171,353.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	276,460	27.470	7,594,356.200	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	357,772	20.850	7,459,546.200	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	174,780	18.100	3,163,518.000	
	TELSTRA CORP LTD	364,092	4.060	1,478,213.520	
	ASX LTD	17,040	89.710	1,528,658.400	
	BHP GROUP LTD	297,601	39.960	11,892,135.960	
	AMPOL LTD	20,946	28.220	591,096.120	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	19.760	1,019,695.040	
	CSL LIMITED	45,984	298.310	13,717,487.040	
	REA GROUP LTD	5,828	167.960	978,870.880	
	TRANSURBAN GROUP	312,883	13.690	4,283,368.270	
	COCHLEAR LTD	7,309	215.650	1,576,185.850	
	ORIGIN ENERGY LTD	141,367	5.010	708,248.670	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	178,345	97.900	17,459,975.500	
	RIO TINTO LIMITED	38,089	95.830	3,650,068.870	
	APA GROUP	118,205	9.700	1,146,588.500	
	ARISTOCRAT LEISU	62,013	44.670	2,770,120.710	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	269,430	4.400	1,185,492.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,246	56.780	2,625,847.880	
	ORICA LTD	41,311	13.900	574,222.900	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	10.640	660,914.240	
BLUESCOPE STEEL LTD	46,777	21.180	990,736.860		
SYDNEY AIRPORT	142,258	8.590	1,221,996.220		

	MACQUARIE GROUP LTD	35,160	201.960	7,100,913.600	
	SUNCORP GROUP LTD	141,700	10.850	1,537,445.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	331,861	28.630	9,501,180.430	
	NEWCREST MINING LTD	86,879	23.170	2,012,986.430	
	OIL SEARCH LTD	211,926	4.040	856,181.040	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	107,483	5.010	538,489.830	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,822	11.960	1,720,111.120	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	94,627	9.100	861,105.700	
	REECE LTD	30,319	24.530	743,725.070	
	SANTOS LTD	200,410	6.480	1,298,656.800	
	SONIC HEALTHCARE	48,014	43.630	2,094,850.820	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	24,711	31.860	787,292.460	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	5.050	1,083,714.850	
	WESFARMERS LTD	114,666	59.850	6,862,760.100	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	101,110	22.030	2,227,453.300	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	129,590	40.660	5,269,129.400	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	29.120	452,903.360	
	SEEK LTD	36,140	35.220	1,272,850.800	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	122.530	745,717.580	
	AUSNET SERVICES	165,066	2.520	415,966.320	
	BRAMBLES LTD	159,454	10.580	1,687,023.320	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.450	376,258.450	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	3.990	562,446.360	
	AURIZON HOLDINGS LTD	153,654	3.390	520,887.060	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	75,903	12.080	916,908.240	
	XERO LTD	14,063	141.100	1,984,289.300	
	IDP EDUCATION LTD	22,852	35.590	813,302.680	
	AFTERPAY LTD	22,311	95.890	2,139,401.790	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	6.820	815,494.680	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.370	954,228.980	
	SOUTH32 LTD(AUD)	490,548	3.820	1,873,893.360	
	COLES GROUP LTD	127,363	17.860	2,274,703.180	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	53.080	722,100.320	
	オーストラリア・ドル 小計	6,991,335		152,473,068.560 (12,409,783,050)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	24,568	60.650	1,490,049.200	
	BARRICK GOLD CORP	186,117	22.830	4,249,051.110	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	16.710	355,455.120	
	BANK OF MONTREAL	65,066	138.730	9,026,606.180	
	BANK OF NOVA SCOTIA	121,791	86.120	10,488,640.920	

NATIONAL BANK OF CANADA	34,617	96.500	3,340,540.500	
BCE INC	7,275	65.770	478,476.750	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	142,338	74.250	10,568,596.500	
BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	31.010	874,233.920	
SAPUTO INC	25,395	29.050	737,724.750	
BLACKBERRY LTD	46,671	11.190	522,248.490	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	66,161	17.650	1,167,741.650	
CGI INC	22,985	108.780	2,500,308.300	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	63.980	982,604.840	
CAE INC	30,443	30.440	926,684.920	
CAMECO CORP	34,212	27.940	955,883.280	
ROGERS COMM-CL B	37,308	57.760	2,154,910.080	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	45,311	142.030	6,435,521.330	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	119,324	52.970	6,320,592.280	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	178.700	1,052,364.300	
CANADIAN UTILITIES LTD	19,790	34.880	690,275.200	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	71,282	164.710	11,740,858.220	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	52.070	1,083,837.050	
OPEN TEXT CORP	29,886	60.670	1,813,183.620	
EMPIRE CO LTD	15,093	37.620	567,798.660	
KINROSS GOLD CORP	118,575	6.770	802,752.750	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	85.880	855,622.440	
FORTIS INC	50,718	57.980	2,940,629.640	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	28.470	1,620,341.580	
TELUS CORP	31,890	29.400	937,566.000	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	37.890	956,722.500	
IMPERIAL OIL LTD	21,854	44.380	969,880.520	
ENBRIDGE INC	201,101	48.080	9,668,936.080	
IGM FINANCIAL INC	6,069	46.570	282,633.330	
MANULIFE FINANCIAL CORP	196,554	24.010	4,719,261.540	
LOBLAW CO LTD	18,513	99.210	1,836,674.730	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	77,328	50.000	3,866,400.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	29,616	101.560	3,007,800.960	
SUN LIFE FINANCIAL INC	55,561	69.380	3,854,822.180	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,733	577.490	1,578,280.170	
METRO INC	28,252	63.030	1,780,723.560	
EMERA INC	29,683	59.450	1,764,654.350	
ONEX CORP	6,646	97.430	647,519.780	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	29.760	558,476.160	
POWER CORP OF CANADA	56,968	42.120	2,399,492.160	
QUEBECOR INC-B	16,042	28.300	453,988.600	

ROYAL BANK OF CANADA	142,631	130.180	18,567,703.580	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	67,760	92.330	6,256,280.800	
SHAW COMM INC-B	49,269	37.580	1,851,529.020	
SUNCOR ENERGY INC	150,764	31.310	4,720,420.840	
LUNDIN MINING CORP	64,310	10.850	697,763.500	
TECK RESOURCES LTD-CL B	42,459	34.650	1,471,204.350	
THOMSON REUTERS CORP	16,826	153.550	2,583,632.300	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,388	108.810	1,021,508.280	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	182,831	95.330	17,429,279.230	
TC ENERGY CORP	95,169	58.090	5,528,367.210	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,298	112.650	1,047,419.700	
WESTON (GEORGE) LTD	7,886	140.120	1,104,986.320	
INTACT FINANCIAL CORP	18,112	161.360	2,922,552.320	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	45,803	51.730	2,369,389.190	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,075	2,182.120	4,527,899.000	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	20,039	166.250	3,331,483.750	
TOURMALINE OIL CORP	32,364	41.240	1,334,691.360	
KEYERA CORP	23,772	28.380	674,649.360	
PARKLAND CORP	14,497	33.780	489,708.660	
ALTAGAS LTD	24,236	24.940	604,445.840	
PEMBINA PIPELINE CORP	56,442	37.570	2,120,525.940	
DOLLARAMA INC	30,727	58.440	1,795,685.880	
CENOVUS ENERGY INC W/I	134,422	15.700	2,110,425.400	
NORTHLAND POWER INC	23,490	37.310	876,411.900	
TMX GROUP LTD	5,058	124.060	627,495.480	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,971	48.170	1,299,193.070	
IVANHOE MINES LTD	61,930	9.930	614,964.900	
NUTRIEN LTD	58,919	89.450	5,270,304.550	
TFI INTERNATIONAL INC	8,999	137.760	1,239,702.240	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	11,346	55.980	635,149.080	
WSP GLOBAL INC	12,227	178.700	2,184,964.900	
IA FINANCIAL CORP INC	11,660	70.690	824,245.400	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	46.970	774,300.450	
NUVEI CORP	4,960	75.820	376,067.200	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	42.920	465,467.400	
AIR CANADA	17,940	21.920	393,244.800	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	30,081	75.690	2,276,830.890	
SHOPIFY INC	11,403	1,857.220	21,177,879.660	
FIRSTSERVICE CORP	3,503	245.720	860,757.160	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	12.180	226,962.120	
HYDRO ONE LTD	35,738	31.180	1,114,310.840	
カナダ・ドル 小計	3,907,424		251,827,170.070	

				(22,483,129,744)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	118,600	3.780	448,308.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	184,300	31.900	5,879,170.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	6.990	254,436.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.440	650,416.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.790	572,118.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.240	706,876.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	352,853	11.350	4,004,881.550	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.440	1,972,549.680	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	4.950	782,347.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	114,200	26.780	3,058,276.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.090	287,145.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	18.830	395,430.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.180	758,252.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	295,215	3.470	1,024,396.050	
シンガポール・ドル 小計	3,238,940		20,794,601.780 (1,731,982,382)		
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	268,219	8.816	2,364,618.700	
	LOGITECH INTL-REG	18,008	74.820	1,347,358.560	
	NESTLE SA-REGISTERED	282,643	124.940	35,313,416.420	
	CIE FINANC RICHEMONT	52,591	142.450	7,491,587.950	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	70,272	377.000	26,492,544.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	246.100	1,014,424.200	
	SIKA INHABER	14,444	377.300	5,449,721.200	
	SGS SA-REG	613	2,973.000	1,822,449.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	219,694	74.660	16,402,354.040	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	142.000	604,778.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	413	2,188.000	903,644.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	19.080	381,199.320	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	509.800	1,268,892.200	
	ABB LTD	164,956	33.730	5,563,965.880	
	ADECCO GROUP AG-REG	17,928	45.330	812,676.240	
	GEBERIT AG	3,688	733.600	2,705,516.800	
	LONZA GROUP AG-REG	7,290	752.600	5,486,454.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	110	11,900.000	1,309,000.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	117,600.000	1,293,600.000	
	GIVAUDAN-REG	901	4,807.000	4,331,107.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	15,033	387.300	5,822,280.900	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,604	403.200	1,453,132.800	
	HOLCIM LTD	54,716	45.210	2,473,710.360	
TEMENOS GROUP	6,753	125.150	845,137.950		
BACHEM HOLDING AG	500	633.000	316,500.000		

	SONOVA HOLDING AG	5,191	343.900	1,785,184.900	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,641	277.400	1,564,813.400	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,054	2,050.000	2,160,700.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	278.400	832,694.400	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	53.100	243,835.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,671	241.000	402,711.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,090	547.200	1,690,848.000	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	118.450	622,573.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING	834	936.500	781,041.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	88.650	712,746.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,294	1,488.500	3,414,619.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,661	59.200	1,400,731.200	
	SWISS RE LTD	30,600	88.300	2,701,980.000	
	ALCON INC	50,504	77.160	3,896,888.640	
	UBS GROUP AG	353,905	16.475	5,830,584.870	
	VAT GROUP AG	2,500	453.000	1,132,500.000	
スイス・フラン	小計	1,735,060		162,444,520.330 (20,016,413,795)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	66,144	590.600	39,064,646.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	41,150	499.800	20,566,770.000	
	ERICSSON LM-B SHS	298,417	94.940	28,331,709.980	
	GETINGE AB-B SHS	24,421	385.400	9,411,853.400	
	INVESTOR AB-A SHS	55,733	228.300	12,723,843.900	
	LUNDBERGS B	7,382	495.500	3,657,781.000	
	SKF AB-B SHS	35,049	202.900	7,111,442.100	
	SANDVIK AB	115,413	234.800	27,098,972.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	166,438	129.650	21,578,686.700	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	223.100	7,061,784.300	
	SWEDBANK AB	89,378	182.800	16,338,298.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	54,280	154.200	8,369,976.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	94.640	13,176,727.200	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	201.000	4,761,891.000	
	VOLVO AB-B SHS	137,132	200.100	27,440,113.200	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	70.800	11,209,693.200	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	127.500	5,999,512.500	
	INDUSTRIVARDEN A	14,273	284.400	4,059,241.200	
	INDUSTRIVARDEN C	10,905	280.100	3,054,490.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	25,219	212.900	5,369,125.100	
	SECURITAS AB-B SHS	42,251	130.700	5,522,205.700	
	INVESTOR AB-B SHS	174,209	218.700	38,099,508.300	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	165.500	11,733,288.000	
	ASSA ABLOY AB-B	102,906	269.600	27,743,457.600	
	TELIA CO AB	269,954	34.965	9,438,941.610	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	370.000	7,681,940.000	

	BOLIDEN AB	31,677	340.200	10,776,515.400	
	ALFA LAVAL AB	29,835	355.800	10,615,293.000	
	KINNEVIK AB-B	21,722	313.050	6,800,072.100	
	FASTIGHETS AB BALDER	11,401	650.000	7,410,650.000	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	534.000	4,810,806.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	45,158	138.750	6,265,672.500	
	NIBE INDUSTRIER AB	137,747	128.000	17,631,616.000	
	HEXAGON AB-B SHS	203,083	135.350	27,487,284.050	
	SAGAX AB	18,348	315.800	5,794,298.400	
	EPIROC AB-A	68,223	224.700	15,329,708.100	
	EPIROC AB-B	38,943	188.000	7,321,284.000	
	ESSITY AB-B	63,119	290.300	18,323,445.700	
	EQT AB	30,003	512.800	15,385,538.400	
	EMBRACER GROUP AB	49,142	94.120	4,625,245.040	
	LIFCO AB	25,738	258.100	6,642,977.800	
	EVOLUTION AB	17,528	1,125.000	19,719,000.000	
	NORDEA BANK ABP	326,994	107.360	35,106,075.840	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	341.000	5,096,245.000	
	SINCH AB	56,299	106.600	6,001,473.400	
	スウェーデン・クローネ 小計	3,421,184		607,749,100.420 (7,615,096,228)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,457	1,030.500	10,775,938.500	
	A P MOLLER A/S	570	21,200.000	12,084,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	19,660.000	6,704,060.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	112.750	7,748,743.750	
	GENMAB A/S	6,863	2,519.000	17,287,897.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,271	519.000	10,520,649.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,853.000	2,319,489.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	169,308	751.000	127,150,308.000	
	GN STORE NORD A/S	14,796	385.000	5,696,460.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	102,901	205.300	21,125,575.300	
	COLOPLAST-B	11,033	1,070.500	11,810,826.500	
	DSV A/S	20,225	1,440.000	29,124,000.000	
	DEMANT A/S	10,739	315.300	3,386,006.700	
	TRYG A/S	35,784	166.700	5,965,192.800	
	PANDORA A/S	9,639	859.400	8,283,756.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	8,980	508.600	4,567,228.000	
	AMBU A/S B	14,156	181.850	2,574,268.600	
	ORSTED A/S	19,427	825.000	16,027,275.000	
	デンマーク・クローネ 小計	525,028		303,151,674.750 (5,235,429,423)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.720	850,944.720	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	12.230	604,761.270	
	FISHER & PAYKEL	57,388	32.200	1,847,893.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	144,639	4.550	658,107.450	

	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.050	373,490.700	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.720	586,044.640	
ニュージーランド・ドル 小計		547,598		4,921,242.380 (380,018,337)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	212.800	9,193,385.600	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	63.200	8,155,075.200	
	TELENOR ASA	67,591	134.050	9,060,573.550	
	SCHIBSTED ASA	7,537	354.500	2,671,866.500	
	ORKLA ASA	67,452	86.600	5,841,343.200	
	EQUINOR ASA	94,618	232.750	22,022,339.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	460.000	6,988,780.000	
	AKER BP ASA	15,217	311.000	4,732,487.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	213.100	3,555,147.300	
	ADEVINTA ASA	22,265	121.050	2,695,178.250	
	DNB BANK ASA	90,740	199.850	18,134,389.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	307.400	2,288,593.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		576,979		95,339,158.100 (1,209,853,916)
ユーロ	CRH PLC	80,193	44.340	3,555,757.620	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,228	128.750	2,218,105.000	
	KERRY GROUP PLC-A	15,455	115.750	1,788,916.250	
	KINGSPAN GROUP PLC	14,446	101.950	1,472,769.700	
	UMICORE	17,112	38.000	650,256.000	
	AIR LIQUIDE	48,127	154.520	7,436,584.040	
	AIRBUS SE	59,916	105.580	6,325,931.280	
	AXA SA	188,918	25.370	4,792,849.660	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	67,438	30.740	2,073,044.120	
	ADIDAS AG	19,297	254.800	4,916,875.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	111,777	18.500	2,067,874.500	
	DASSAULT AVIATION SA	2,950	92.000	271,400.000	
	DANONE	64,017	53.020	3,394,181.340	
	SAFRAN SA	34,977	103.820	3,631,312.140	
	INTESA SANPAOLO	1,685,148	2.215	3,732,602.820	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,441	89.660	2,908,660.060	
	ACCOR SA	17,380	27.000	469,260.000	
	BOUYGUES	21,417	30.260	648,078.420	
	BNP PARIBAS	114,118	56.710	6,471,631.780	
	THALES SA	10,448	73.040	763,121.920	
	CAPGEMINI SA	15,854	206.000	3,265,924.000	
	UNICREDIT SPA	221,530	12.876	2,852,420.280	
	KONINKLIJKE DSM NV	17,250	197.850	3,412,912.500	
	COMMERZBANK AG	106,215	6.507	691,141.000	
	EIFFAGE	8,477	84.160	713,424.320	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	43,525	34.130	1,485,508.250	
UNITED INTERNET	9,882	32.930	325,414.260		

FUCHS PETROLUB SE PEF	5,546	39.840	220,952.640	
PUBLICIS GROUPE	24,124	57.760	1,393,402.240	
FAURECIA	10,774	39.800	428,805.200	
IBERDROLA SA	577,710	9.738	5,625,739.980	
ENI SPA	254,939	12.206	3,111,785.430	
JERONIMO MARTINS	33,135	20.310	672,971.850	
KESKO OYJ-B	30,018	29.320	880,127.760	
KBC GROUPE	26,256	74.760	1,962,898.560	
HANNOVER RUECK SE	5,923	160.800	952,418.400	
WARTSILA OYJ	48,612	12.000	583,344.000	
L'OREAL	25,308	421.050	10,655,933.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,969	710.000	19,857,990.000	
GEA GROUP AG	16,492	47.190	778,257.480	
BOLLORE	70,816	4.658	329,860.920	
MEDIOBANCA SPA	57,442	10.040	576,717.680	
MICHELIN(CGDE) -B	17,737	141.950	2,517,767.150	
CONTINENTAL AG	11,972	95.270	1,140,572.440	
DEUTSCHE POST AG-REG	100,229	53.320	5,344,210.280	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	21.170	448,931.020	
OMV AG	12,817	49.800	638,286.600	
VERBUND AG	6,916	97.000	670,852.000	
PERNOD-RICARD	21,254	210.400	4,471,841.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	15,912	84.080	1,337,880.960	
RENAULT SA	19,019	29.790	566,576.010	
REPSOL SA	150,289	10.100	1,517,918.900	
REMY COINTREAU	1,860	205.400	382,044.000	
MERCK KGAA	12,300	224.500	2,761,350.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	51,842	59.810	3,100,670.020	
RWE AG	65,790	34.520	2,271,070.800	
SEB SA	2,439	135.600	330,728.400	
SOCIETE GENERALE-A	84,258	29.085	2,450,643.930	
VINCI S.A.	53,037	85.440	4,531,481.280	
SODEXO	9,325	76.360	712,057.000	
SOFINA	1,382	432.000	597,024.000	
SOLVAY SA	7,183	100.850	724,405.550	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	54,434	166.920	9,086,123.280	
VIVENDI SE	73,788	11.250	830,115.000	
SAP SE	104,950	119.380	12,528,931.000	
TELEFONICA S.A	535,613	3.724	1,994,622.810	
TOTALENERGIES SE	251,987	44.090	11,110,106.830	
VALEO	25,393	27.610	701,100.730	
E.ON SE	232,898	11.370	2,648,050.260	
VOEST-ALPINE AG	9,875	30.540	301,582.500	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	67.850	703,333.100	
SIEMENS AG-REG	76,815	151.040	11,602,137.600	

UPM-KYMMENE OYJ	55,982	32.870	1,840,128.340	
ING GROEP NV-CVA	383,701	12.232	4,693,430.630	
PUMA AG	10,448	106.500	1,112,712.000	
BAYER AG	99,400	46.610	4,633,034.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	65,015	15.695	1,020,410.420	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,941	71.260	1,207,215.660	
DAIMLER AG	86,369	74.250	6,412,898.250	
BASF SE	90,521	59.830	5,415,871.430	
BEIERSDORF AG	10,342	91.900	950,429.800	
HEIDELBERGCEMENT AG	16,567	59.360	983,417.120	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	19,754	54.020	1,067,111.080	
ASM INTERNATIONAL NV	4,825	374.300	1,805,997.500	
ORANGE	215,305	9.225	1,986,188.620	
SAMPO OYJ-A SHS	45,916	43.750	2,008,825.000	
RANDSTAD NV	11,017	57.780	636,562.260	
ALLIANZ SE	41,289	202.750	8,371,344.750	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.774	1,282,468.260	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	107,429	30.340	3,259,395.860	
HERMES INTL	3,212	1,592.500	5,115,110.000	
ENDESA S.A.	27,027	19.635	530,675.140	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	70,248	6.018	422,752.460	
ERSTE GROUP BANK AG	31,753	39.970	1,269,167.410	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	14,252	248.100	3,535,921.200	
ARCELOR MITTAL (NL)	62,751	25.745	1,615,524.490	
DASSAULT SYSTEMES SA	67,781	53.090	3,598,493.290	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,877	21.440	490,482.880	
HEINEKEN NV	26,744	90.620	2,423,541.280	
AKZO NOBEL	18,548	95.740	1,775,785.520	
ASML HOLDING NV	41,583	685.000	28,484,355.000	
AEGON NV	189,323	4.021	761,267.780	
VOLKSWAGEN AG	2,782	273.200	760,042.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	19,323	180.340	3,484,709.820	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	679,667	5.110	3,473,098.370	
KERING	7,594	700.500	5,319,597.000	
CNP ASSURANCES	13,987	21.700	303,517.900	
FORTUM OYJ	38,625	26.550	1,025,493.750	
AGEAS	17,055	45.640	778,390.200	
UCB SA	12,778	99.680	1,273,711.040	
NEMETSCHEK SE	5,095	107.050	545,419.750	
CARREFOUR SA	61,189	15.580	953,324.620	
NATURGY ENERGY GROUP SA	16,289	25.290	411,948.810	
NOKIA OYJ	548,497	5.319	2,917,455.540	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	93,687	30.435	2,851,363.840	

WOLTERS KLUWER-CVA	27,306	103.300	2,820,709.800	
SANOFI	114,509	86.530	9,908,463.770	
STMICROELECTRONICS NV	69,521	42.480	2,953,252.080	
ELISA OYJ	13,642	53.620	731,484.040	
BANCO SANTANDER SA	1,768,607	2.701	4,777,007.500	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	46,237	18.960	876,653.520	
QIAGEN N.V.	24,503	48.440	1,186,925.320	
DEUTSCHE BANK AG-REG	210,638	10.920	2,300,166.960	
BMW VORZUG	6,957	73.850	513,774.450	
ENEL SPA	799,737	6.690	5,350,240.530	
COLRUYT NV	4,673	40.310	188,368.630	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	325,869	15.852	5,165,675.380	
SARTORIUS AG	2,686	575.200	1,544,987.200	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	42.280	324,964.080	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	131,445	39.985	5,255,828.320	
RATIONAL AG	479	828.000	396,612.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	171.000	644,841.000	
BECHTLE AG	7,533	61.700	464,786.100	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	2.631	898,347.050	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,943	107.940	1,505,007.420	
TELEPERFORMANCE	6,057	375.400	2,273,797.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,262	138.750	2,672,602.500	
EURAZEO	3,008	73.800	221,990.400	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,433	97.180	1,013,878.940	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,883	75.500	821,666.500	
INDITEX	110,837	28.400	3,147,770.800	
ESSILORLUXOTTICA	29,125	185.140	5,392,202.500	
SNAM SPA	198,963	5.134	1,021,476.040	
CREDIT AGRICOLE SA	128,627	12.234	1,573,622.710	
ORPEA	4,932	83.980	414,189.360	
ENAGAS	23,477	20.600	483,626.200	
WENDEL	2,220	98.450	218,559.000	
TENARIS SA	52,985	8.918	472,520.230	
TELECOM ITALIA SPA	757,171	0.441	333,912.410	
ATLANTIA SPA	45,299	16.970	768,724.030	
PROXIMUS	13,739	16.190	222,434.410	
TERNA SPA	152,700	6.810	1,039,887.000	
BIOMERIEUX	4,612	124.900	576,038.800	
GRIFOLS SA	30,687	15.410	472,886.670	
FERROVIAL SA	46,794	25.490	1,192,779.060	
LANXESS AG	7,194	52.680	378,979.920	
NESTE OYJ	43,290	43.230	1,871,426.700	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	19,572	25.420	497,520.240	
RECORDATI SPA	10,303	53.560	551,828.680	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	12.960	716,739.840	

MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5,765	168.600	971,979.000	
KONE OYJ	34,549	61.020	2,108,179.980	
ELIA GROUP	2,862	112.500	321,975.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,916	477.500	1,392,390.000	
ENGIE	174,652	13.066	2,282,003.030	
ALSTOM	30,600	30.930	946,458.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	41,549	12.390	514,792.110	
IPSEN SA	3,646	91.460	333,463.160	
ARKEMA SA	7,025	120.750	848,268.750	
LEGRAND SA	27,604	100.900	2,785,243.600	
AMPLIFON SPA	11,372	41.780	475,122.160	
ADP	2,313	106.050	245,293.650	
ORION OYJ	8,051	34.780	280,013.780	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	8.398	336,659.020	
SYMRISE AG	13,437	129.850	1,744,794.450	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	46.440	1,125,148.320	
PRYSMIAN SPA	29,366	32.800	963,204.800	
DIASORIN SPA	2,223	180.000	400,140.000	
CAIXABANK	485,422	2.296	1,114,528.910	
BUREAU VERITAS SA	29,810	28.950	862,999.500	
GETLINK	56,534	13.650	771,689.100	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	21.580	603,635.760	
SUEZ SA	34,245	19.775	677,194.870	
AMADEUS IT GROUP SA	46,086	57.560	2,652,710.160	
BRENTAG SE	16,310	76.680	1,250,650.800	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	27.860	650,252.400	
EDENRED	24,865	38.840	965,756.600	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.352	231,401.520	
LEG IMMOBILIEN SE	6,489	121.700	789,711.300	
KION GROUP AG	7,508	97.520	732,180.160	
VONOVIA SE	74,936	50.140	3,757,291.040	
KNORR-BREMSE AG	6,860	87.580	600,798.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,475	67.180	1,912,950.500	
FERRARI NV	12,074	229.200	2,767,360.800	
CNH INDUSTRIAL NV	106,155	15.675	1,663,979.620	
AROUNDTOWN SA	106,018	5.408	573,345.340	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	39.370	318,582.040	
MONCLER SPA	21,477	66.060	1,418,770.620	
NEXI SPA	43,586	14.250	621,100.500	
PROSUS NV	94,283	72.170	6,804,404.110	
JDE PEET'S BV	7,308	26.000	190,008.000	
SIEMENS ENERGY AG	35,809	22.660	811,431.940	
TELEFONICA SA-RTS	527,117	0.142	74,850.610	
INPOST SA	20,395	9.515	194,058.420	
EURONEXT NV	9,619	85.850	825,791.150	

	IMCD NV	6,039	198.900	1,201,157.100	
	WORLDLINE SA	23,570	48.130	1,134,424.100	
	NN GROUP NV	28,124	45.010	1,265,861.240	
	FINECOBANK SPA	65,274	15.675	1,023,169.950	
	ARGENX SE	4,403	262.300	1,154,906.900	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	75,904	25.125	1,907,088.000	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	43,184	30.535	1,318,623.440	
	ZALANDO SE	22,986	74.320	1,708,319.520	
	STELLANTIS NV	195,785	16.490	3,228,494.650	
	AENA SME SA	7,240	129.850	940,114.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	53,041	52.480	2,783,591.680	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,807	49.285	828,332.990	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	12.700	434,987.700	
	EXOR NV	9,966	79.160	788,908.560	
	SCOUT24 SE	9,670	59.900	579,233.000	
	COVESTRO AG	19,158	52.120	998,514.960	
	HELLOFRESH SE	16,990	74.220	1,260,997.800	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	78,153	51.040	3,988,929.120	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	11.050	616,026.450	
	AMUNDI SA	5,924	70.500	417,642.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	44,754	10.175	455,371.950	
	ADYEN NV	1,934	2,420.000	4,680,280.000	
	UNIPER SE	10,427	39.890	415,933.030	
	DELIVERY HERO SE	16,645	103.850	1,728,583.250	
ユーロ	小計	18,921,667		494,129,378.580 (63,451,153,503)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	15.900	2,607,600.000	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	75.200	12,182,400.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	53,500	46.150	2,469,025.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	121,440	468.200	56,858,208.000	
	MTR CORP	137,500	41.650	5,726,875.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	145.300	11,013,740.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	123,450	33.650	4,154,092.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	47.250	6,898,500.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,175,456	11.760	13,823,362.560	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	242,000	41.850	10,127,700.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	343,000	24.800	8,506,400.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	31.250	5,095,812.500	
	SINO LAND CO	273,400	9.610	2,627,374.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	138,500	96.600	13,379,100.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	44.050	2,180,475.000	

TECHTRONIC INDUSTRIES CO	140,000	166.800	23,352,000.000	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	19.700	3,270,200.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	14.100	3,062,520.000	
AIA GROUP LTD	1,222,827	81.800	100,027,248.600	
HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.620	4,725,900.000	
SANDS CHINA LTD	252,000	18.840	4,747,680.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	133,000	30.950	4,116,350.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	19.460	2,027,732.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	41.000	6,139,750.000	
ESR CAYMAN LTD	203,800	25.750	5,247,850.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.650	1,759,500.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	20.600	3,102,360.000	
WH GROUP LTD	897,000	4.900	4,395,300.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	287,832	49.900	14,362,816.800	
CK ASSET HOLDINGS LTD	219,832	46.750	10,277,146.000	
香港・ドル 小計	8,187,653		348,265,017.960 (5,070,738,661)	
合計	109,426,331		642,600,793.560 (642,600,793,560)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年12月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	116,857.000	1,286,595.570	
		GOODMAN GROUP	169,783.000	4,297,207.730	
		GPT GROUP	207,292.000	1,075,845.480	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,209,245.000	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,518,832.500	
		STOCKLAND	243,481.000	1,054,272.730	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	648,635.690	
	オーストラリア・ドル 小計		2,008,499.000	11,090,634.700 (902,666,758)	
シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	398,606.000	1,179,873.760	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	545,177.000	1,106,709.310	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	394,215.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	513,190.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,406,183.000	3,193,988.070	

				(266,027,266)	
投資信託受益証券 合計			3,414,682	1,168,694,024 (1,168,694,024)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,817.000	699,593.370	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,800.000	2,924,772.000	
		AMERICAN TOWER CORP	45,792.000	12,481,525.440	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	150,150.000	1,258,257.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,731.000	3,362,309.970	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,549.000	1,660,040.900	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,440.000	1,813,323.600	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	43,538.000	8,411,976.980	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	28,517.000	4,765,190.700	
		DUKE REALTY TRUST	38,708.000	2,384,025.720	
		EQUINIX INC	9,055.000	7,224,893.950	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,065.000	1,366,488.900	
		EQUITY RESIDENTIAL	36,415.000	3,163,006.900	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,517.000	2,252,796.560	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,707.000	2,652,077.970	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,001.000	1,790,903.790	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	75,616.000	1,257,494.080	
		INVITATION HOMES INC	59,509.000	2,542,819.570	
		IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,377,064.800	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	54,345.000	1,186,894.800	
		MID AMERICA	11,796.000	2,553,480.120	
		PROLOGIS INC	74,245.000	11,810,894.600	
		PUBLIC STORAGE	15,874.000	5,524,152.000	
		REALTY INCOME CORP	55,770.000	3,733,243.800	
		REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	1,062,341.730	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	11,162.000	4,006,376.660	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	33,159.000	5,054,094.780	
		SUN COMMUNITIES INC	12,016.000	2,393,346.880	
		UDR INC	30,930.000	1,805,693.400	
		VENTAS INC	40,408.000	1,954,534.960	
		VICI PROPERTIES INC	64,021.000	1,815,635.560	
		VORNADO REALTY TRUST	19,078.000	802,039.120	
	WELLTOWER INC	42,856.000	3,544,619.760		
WEYERHAEUSER CO	72,337.000	2,894,926.740			
WP CAREY INC	19,446.000	1,541,095.500			
アメリカ・ドル	小計		1,273,309.000	115,071,932.610 (13,067,568,667)	
イギリス・ポ ンド	BRITISH LAND CO PLC		76,858.000	399,200.450	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	556,098.330	
	SEGRO PLC	116,375.000	1,639,723.750	
イギリス・債券 小計		267,261.000	2,595,022.530 (390,680,642)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,220.000	466,649.400	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	296,274.000	
カナダ・ドル 小計		21,687.000	762,923.400 (68,113,801)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	330,047.140	
	GECINA SA	4,763.000	557,747.300	
	KLEPIERRE	17,099.000	330,865.650	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	780,109.600	
ユーロ 小計		39,445.000	1,998,769.690 (256,662,016)	
香港・ドル	LINK REIT	195,000.000	13,191,750.000	
香港・ドル 小計		195,000.000	13,191,750.000 (192,071,880)	
投資証券 合計		1,796,702	13,975,097,006 (13,975,097,006)	
合計			15,143,791,030 (15,143,791,030)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 607銘柄	70.82	-	-	74.16
	投資証券 35銘柄	-	-	1.95	
イギリス・債券	株式 81銘柄	4.10	-	-	4.24
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.12	-	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄	1.85	-	-	2.02
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.35	-	-	3.43
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.26	-	-	0.30
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 41銘柄	2.99	-	-	3.04
スウェーデン・クローナ	株式 45銘柄	1.14	-	-	1.16
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.78	-	-	0.80
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.06	-	-	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.18	-	-	0.18

ユーロ	株式	229銘柄	9.47	-	-	9.69
	投資証券	4銘柄	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.76	-	-	0.80
	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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)

2021年12月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,202,717,508
コール・ローン	2,024,927,058
国債証券	565,466,264,765
派生商品評価勘定	53,843
未収入金	297,970,856
未収利息	1,652,775,557
前払費用	999,323,296
流動資産合計	573,644,032,883
資産合計	
573,644,032,883	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,808,378,941
未払金	84,403,777
未払解約金	12,581,000
流動負債合計	1,905,363,718
負債合計	
1,905,363,718	
純資産の部	
元本等	
元本	395,213,268,647
剰余金	
剰余金又は欠損金()	176,525,400,518
元本等合計	571,738,669,165
純資産合計	
571,738,669,165	
負債純資産合計	
573,644,032,883	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年12月13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	397,546,249,818円
同期中追加設定元本額	318,315,732,629円
同期中一部解約元本額	320,648,713,800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>	7,355,221,548円
たわらノーロード バランス(堅実型)	700,803,083円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,775,827,239円
たわらノーロード バランス(積極型)	832,791,854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)	41,364,372円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	1,216,555,123円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	1,440,511,584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)	432,266,002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)	196,896,446円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,410,347円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	16,015,302円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	123,827,418円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	10,893,076円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	17,271,137円
投資のソムリエ	235,657,282,764円
投資のソムリエ<DC年金>	11,997,113,598円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,913,893,108円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	53,749,027,441円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,645,148,637円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	7,351,742,584円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	177,259,832円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	93,879,512円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	59,738,025円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	569,769,271円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	14,434,625,731円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,695,941,834円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	136,117,863円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	71,165,445円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	59,589,403円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,272,001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)	19,917,299,736円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	7,239,976,853円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	6,341,679,097円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	130,377,675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)	531,701,085円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	46,772,392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)	324,870,197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)	647,085,677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)	921,602,534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)	2,049,047,614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)	2,222,164,083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)	2,940,401,092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)	118,069,032円
計	395,213,268,647円
2. 受益権の総数	395,213,268,647口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年12月13日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	555,755,346	
合計	555,755,346	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年6月23日から2021年12月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年12月13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	570,579,421,906	-	572,387,747,004	1,808,325,098
アメリカ・ドル	272,200,930,465	-	272,488,022,704	287,092,239
イギリス・ポンド	34,434,926,888	-	34,508,515,748	73,588,860
イスラエル・シェケル	2,719,690,695	-	2,764,851,276	45,160,581
オーストラリア・ドル	9,126,114,717	-	9,240,868,906	114,754,189

オフショア・人民元	2,629,536,234	-	2,636,169,799	6,633,565
カナダ・ドル	10,956,506,792	-	11,056,423,033	99,916,241
シンガポール・ドル	2,491,969,762	-	2,508,124,994	16,155,232
スウェーデン・クローナ	1,654,577,071	-	1,657,548,592	2,971,521
デンマーク・クローネ	2,512,528,600	-	2,523,463,041	10,934,441
ノルウェー・クローネ	1,362,309,612	-	1,389,091,623	26,782,011
ポーランド・ズロチ	2,781,696,668	-	2,813,555,421	31,858,753
マレーシア・リンギット	2,854,400,460	-	2,865,851,100	11,450,640
メキシコ・ペソ	3,955,202,357	-	4,077,649,533	122,447,176
ユーロ	220,899,031,585	-	221,857,611,234	958,579,649
合計	570,579,421,906	-	572,387,747,004	1,808,325,098

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年12月13日現在
1口当たり純資産額	1.4467円
(1万口当たり純資産額)	(14,467円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年12月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	13,000,000.000	12,838,007.780	
		US T N/B 0.125 02/15/24	15,000,000.000	14,806,054.650	
		US T N/B 0.125 05/15/23	8,630,000.000	8,584,490.210	
		US T N/B 0.125 06/30/23	8,000,000.000	7,951,874.960	
		US T N/B 0.125 07/15/23	9,000,000.000	8,939,882.790	
		US T N/B 0.125 07/31/23	1,850,000.000	1,836,630.840	
		US T N/B 0.125 08/15/23	8,310,000.000	8,246,701.150	
		US T N/B 0.125 08/31/23	28,040,000.000	27,812,175.000	

US T N/B 0.125 09/15/23	11,120,000.000	11,026,609.340	
US T N/B 0.125 10/15/23	10,000,000.000	9,907,031.200	
US T N/B 0.125 12/15/23	10,000,000.000	9,887,890.600	
US T N/B 0.25 03/15/24	20,000,000.000	19,766,406.200	
US T N/B 0.25 04/15/23	8,130,000.000	8,107,134.370	
US T N/B 0.25 05/15/24	20,000,000.000	19,721,875.000	
US T N/B 0.25 05/31/25	8,970,000.000	8,713,514.060	
US T N/B 0.25 06/15/24	6,810,000.000	6,708,914.060	
US T N/B 0.25 06/30/25	8,990,000.000	8,724,514.060	
US T N/B 0.25 07/31/25	8,980,000.000	8,699,375.000	
US T N/B 0.25 08/31/25	9,920,000.000	9,596,824.940	
US T N/B 0.25 09/30/23	20,960,000.000	20,822,450.000	
US T N/B 0.25 09/30/25	10,000,000.000	9,671,875.000	
US T N/B 0.25 10/31/25	12,000,000.000	11,583,750.000	
US T N/B 0.25 11/15/23	12,280,000.000	12,185,501.460	
US T N/B 0.375 01/31/26	14,430,000.000	13,948,624.140	
US T N/B 0.375 04/15/24	12,740,000.000	12,613,097.620	
US T N/B 0.375 04/30/25	6,870,000.000	6,711,936.340	
US T N/B 0.375 07/15/24	9,000,000.000	8,885,742.120	
US T N/B 0.375 07/31/27	11,250,000.000	10,693,652.280	
US T N/B 0.375 08/15/24	12,240,000.000	12,076,481.180	
US T N/B 0.375 09/15/24	10,000,000.000	9,854,296.800	
US T N/B 0.375 09/30/27	6,470,000.000	6,128,808.560	
US T N/B 0.375 11/30/25	10,540,000.000	10,211,448.380	
US T N/B 0.375 12/31/25	11,000,000.000	10,649,375.000	
US T N/B 0.5 02/28/26	15,820,000.000	15,358,995.230	
US T N/B 0.5 03/31/25	10,000,000.000	9,825,390.600	
US T N/B 0.5 04/30/27	19,120,000.000	18,345,864.080	
US T N/B 0.5 05/31/27	9,610,000.000	9,201,575.000	
US T N/B 0.5 06/30/27	5,320,000.000	5,094,731.250	
US T N/B 0.5 08/31/27	10,590,000.000	10,116,759.370	
US T N/B 0.5 10/31/27	10,000,000.000	9,525,781.200	
US T N/B 0.5 11/30/23	2,000,000.000	1,993,750.000	
US T N/B 0.625 03/31/27	9,460,000.000	9,147,746.110	
US T N/B 0.625 05/15/30	21,100,000.000	19,743,335.830	
US T N/B 0.625 07/31/26	11,960,000.000	11,629,231.250	
US T N/B 0.625 08/15/30	23,270,000.000	21,730,180.340	
US T N/B 0.625 10/15/24	4,060,000.000	4,025,902.330	
US T N/B 0.625 11/30/27	8,510,000.000	8,154,973.430	
US T N/B 0.625 12/31/27	14,160,000.000	13,558,200.000	
US T N/B 0.75 01/31/28	10,270,000.000	9,903,328.840	
US T N/B 0.75 03/31/26	12,400,000.000	12,157,812.500	
US T N/B 0.75 04/30/26	11,530,000.000	11,299,400.000	
US T N/B 0.75 05/31/26	12,100,000.000	11,850,437.500	
US T N/B 0.75 08/31/26	12,830,000.000	12,543,329.680	
US T N/B 0.75 11/15/24	30,000,000.000	29,821,875.000	
US T N/B 0.875 06/30/26	10,300,000.000	10,135,843.750	
US T N/B 0.875 09/30/26	8,320,000.000	8,174,400.000	
US T N/B 0.875 11/15/30	26,920,000.000	25,649,712.500	

US T N/B 1.0 07/31/28	9,000,000.000	8,772,890.580	
US T N/B 1.125 02/15/31	24,380,000.000	23,714,311.650	
US T N/B 1.125 02/28/25	7,790,000.000	7,812,822.200	
US T N/B 1.125 02/28/27	3,840,000.000	3,812,850.000	
US T N/B 1.125 02/29/28	14,380,000.000	14,187,892.110	
US T N/B 1.125 05/15/40	10,780,000.000	9,477,135.880	
US T N/B 1.125 08/15/40	10,540,000.000	9,229,087.500	
US T N/B 1.125 08/31/28	9,870,000.000	9,694,190.620	
US T N/B 1.125 10/31/26	10,000,000.000	9,938,671.800	
US T N/B 1.25 03/31/28	8,000,000.000	7,940,000.000	
US T N/B 1.25 04/30/28	11,000,000.000	10,912,343.750	
US T N/B 1.25 05/15/50	12,230,000.000	10,462,382.800	
US T N/B 1.25 05/31/28	10,850,000.000	10,760,148.430	
US T N/B 1.25 06/30/28	10,000,000.000	9,910,937.500	
US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,493,843.700	
US T N/B 1.25 08/15/31	30,060,000.000	29,459,974.120	
US T N/B 1.25 08/31/24	8,400,000.000	8,478,421.810	
US T N/B 1.25 09/30/28	16,000,000.000	15,832,500.000	
US T N/B 1.25 11/30/26	17,840,000.000	17,837,212.500	
US T N/B 1.375 01/31/25	7,340,000.000	7,421,141.340	
US T N/B 1.375 02/15/23	7,680,000.000	7,765,499.980	
US T N/B 1.375 06/30/23	8,960,000.000	9,077,249.930	
US T N/B 1.375 08/15/50	16,250,000.000	14,336,816.320	
US T N/B 1.375 08/31/23	7,880,000.000	7,983,732.790	
US T N/B 1.375 08/31/26	4,750,000.000	4,781,542.940	
US T N/B 1.375 09/30/23	24,410,000.000	24,738,009.370	
US T N/B 1.375 10/31/28	15,000,000.000	14,961,328.050	
US T N/B 1.375 11/15/31	4,750,000.000	4,701,572.230	
US T N/B 1.375 11/15/40	12,120,000.000	11,064,234.300	
US T N/B 1.5 01/15/23	8,000,000.000	8,099,062.480	
US T N/B 1.5 01/31/27	4,000,000.000	4,052,187.480	
US T N/B 1.5 02/15/30	13,730,000.000	13,812,594.460	
US T N/B 1.5 02/28/23	7,620,000.000	7,717,928.880	
US T N/B 1.5 03/31/23	7,740,000.000	7,844,913.220	
US T N/B 1.5 08/15/26	12,540,000.000	12,701,648.370	
US T N/B 1.5 09/30/24	6,490,000.000	6,593,434.370	
US T N/B 1.5 10/31/24	8,000,000.000	8,126,250.000	
US T N/B 1.5 11/30/24	9,140,000.000	9,280,670.260	
US T N/B 1.625 02/15/26	10,300,000.000	10,482,664.010	
US T N/B 1.625 05/15/26	11,040,000.000	11,236,650.000	
US T N/B 1.625 05/15/31	21,570,000.000	21,895,235.040	
US T N/B 1.625 05/31/23	5,460,000.000	5,550,644.510	
US T N/B 1.625 08/15/29	11,400,000.000	11,583,468.750	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,891,028.120	
US T N/B 1.625 10/31/26	5,100,000.000	5,196,820.280	
US T N/B 1.625 11/15/50	14,120,000.000	13,238,603.050	
US T N/B 1.625 11/30/26	5,310,000.000	5,410,392.180	
US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,308,771.030	
US T N/B 1.75 05/15/23	10,000,000.000	10,176,953.100	

US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	6,912,892.130	
US T N/B 1.75 07/31/24	8,000,000.000	8,184,374.960	
US T N/B 1.75 08/15/41	19,270,000.000	18,697,168.990	
US T N/B 1.75 11/15/29	6,900,000.000	7,076,812.500	
US T N/B 1.75 12/31/24	8,300,000.000	8,491,289.010	
US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	5,117,478.880	
US T N/B 1.875 02/15/41	14,440,000.000	14,330,571.790	
US T N/B 1.875 02/15/51	16,240,000.000	16,166,412.500	
US T N/B 1.875 06/30/26	4,920,000.000	5,063,371.850	
US T N/B 1.875 07/31/26	5,000,000.000	5,147,265.600	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,030,000.000	7,212,615.210	
US T N/B 1.875 11/15/51	7,000,000.000	6,986,601.510	
US T N/B 2.0 02/15/25	15,000,000.000	15,448,828.050	
US T N/B 2.0 02/15/50	8,190,000.000	8,376,194.480	
US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	7,053,205.440	
US T N/B 2.0 05/31/24	8,440,000.000	8,680,342.150	
US T N/B 2.0 06/30/24	6,710,000.000	6,904,223.020	
US T N/B 2.0 08/15/25	15,000,000.000	15,475,781.250	
US T N/B 2.0 08/15/51	16,000,000.000	16,402,500.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	12,150,000.000	12,596,132.810	
US T N/B 2.0 11/15/41	3,660,000.000	3,710,753.870	
US T N/B 2.125 02/29/24	8,810,000.000	9,077,397.240	
US T N/B 2.125 03/31/24	13,170,000.000	13,571,787.850	
US T N/B 2.125 05/15/25	15,000,000.000	15,525,000.000	
US T N/B 2.125 05/31/26	7,070,000.000	7,355,009.370	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	6,371,730.050	
US T N/B 2.125 09/30/24	6,400,000.000	6,614,249.980	
US T N/B 2.125 11/30/23	8,000,000.000	8,228,437.440	
US T N/B 2.125 11/30/24	6,670,000.000	6,894,330.830	
US T N/B 2.125 12/31/22	10,620,000.000	10,817,880.430	
US T N/B 2.25 01/31/24	8,160,000.000	8,423,287.450	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,770,000.000	9,199,592.920	
US T N/B 2.25 03/31/26	7,630,000.000	7,963,216.360	
US T N/B 2.25 04/30/24	8,000,000.000	8,270,624.960	
US T N/B 2.25 05/15/41	16,530,000.000	17,405,573.430	
US T N/B 2.25 08/15/27	22,520,000.000	23,670,631.250	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,890,000.000	7,324,931.250	
US T N/B 2.25 08/15/49	10,490,000.000	11,302,155.410	
US T N/B 2.25 10/31/24	6,560,000.000	6,804,718.700	
US T N/B 2.25 11/15/24	6,020,000.000	6,245,044.510	
US T N/B 2.25 11/15/25	15,000,000.000	15,624,609.300	
US T N/B 2.25 11/15/27	7,650,000.000	8,049,234.370	
US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	8,251,874.960	
US T N/B 2.25 12/31/24	7,210,000.000	7,484,599.550	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	6,006,625.000	
US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,494,000.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	14,230,000.000	15,047,113.210	
US T N/B 2.375 05/15/29	9,450,000.000	10,089,351.550	
US T N/B 2.375 05/15/51	18,720,000.000	20,805,525.000	

US T N/B 2.375 08/15/24	16,620,000.000	17,269,867.920	
US T N/B 2.375 11/15/49	11,040,000.000	12,219,037.440	
US T N/B 2.5 01/31/24	25,000,000.000	25,937,500.000	
US T N/B 2.5 01/31/25	6,000,000.000	6,274,687.500	
US T N/B 2.5 02/15/45	7,670,000.000	8,471,155.420	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,270,000.000	5,851,758.550	
US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,815,837.500	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,896,924.960	
US T N/B 2.5 05/15/24	20,000,000.000	20,807,031.200	
US T N/B 2.5 05/15/46	6,280,000.000	6,976,932.410	
US T N/B 2.5 08/15/23	10,000,000.000	10,317,968.700	
US T N/B 2.625 01/31/26	7,280,000.000	7,704,856.190	
US T N/B 2.625 02/15/29	14,530,000.000	15,734,400.700	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,656,691.380	
US T N/B 2.625 06/30/23	8,780,000.000	9,060,205.430	
US T N/B 2.625 12/31/23	7,320,000.000	7,605,937.500	
US T N/B 2.625 12/31/25	6,300,000.000	6,666,679.640	
US T N/B 2.75 02/15/24	13,390,000.000	13,974,243.320	
US T N/B 2.75 02/15/28	10,000,000.000	10,832,812.500	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,632,510.120	
US T N/B 2.75 04/30/23	7,660,000.000	7,898,776.520	
US T N/B 2.75 05/31/23	7,220,000.000	7,454,932.010	
US T N/B 2.75 06/30/25	5,150,000.000	5,447,331.990	
US T N/B 2.75 07/31/23	8,860,000.000	9,174,945.260	
US T N/B 2.75 08/15/42	5,000,000.000	5,717,578.100	
US T N/B 2.75 08/15/47	7,630,000.000	8,933,656.970	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,287,034.370	
US T N/B 2.75 08/31/25	6,430,000.000	6,807,762.500	
US T N/B 2.75 11/15/23	50,000,000.000	51,998,046.500	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,920,000.000	5,626,865.600	
US T N/B 2.75 11/15/47	6,310,000.000	7,394,531.250	
US T N/B 2.875 04/30/25	6,920,000.000	7,335,200.000	
US T N/B 2.875 05/15/28	6,000,000.000	6,549,843.720	
US T N/B 2.875 05/15/43	4,520,000.000	5,270,390.600	
US T N/B 2.875 05/15/49	13,430,000.000	16,279,678.120	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,827,621.070	
US T N/B 2.875 07/31/25	5,270,000.000	5,600,610.120	
US T N/B 2.875 08/15/28	12,860,000.000	14,073,662.500	
US T N/B 2.875 08/15/45	6,690,000.000	7,896,813.240	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,125,450.740	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,030,000.000	4,795,385.120	
US T N/B 2.875 11/30/23	8,670,000.000	9,043,555.000	
US T N/B 2.875 11/30/25	6,140,000.000	6,550,132.770	
US T N/B 3.0 02/15/47	8,570,000.000	10,434,644.480	
US T N/B 3.0 02/15/48	10,540,000.000	12,948,554.630	
US T N/B 3.0 02/15/49	12,670,000.000	15,674,175.700	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,270,000.000	3,884,657.800	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	1,550,217.180	
US T N/B 3.0 05/15/47	6,780,000.000	8,277,956.240	

US T N/B 3.0 08/15/48	12,660,000.000	15,589,603.120	
US T N/B 3.0 09/30/25	6,360,000.000	6,800,231.240	
US T N/B 3.0 10/31/25	5,620,000.000	6,015,156.250	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,170,000.000	7,384,718.750	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,370,000.000	4,067,958.570	
US T N/B 3.125 02/15/42	4,040,000.000	4,883,981.230	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,760,000.000	5,755,509.320	
US T N/B 3.125 05/15/48	7,980,000.000	10,034,850.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	7,550,000.000	9,196,843.750	
US T N/B 3.125 11/15/28	15,380,000.000	17,143,893.740	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,780,000.000	4,560,510.900	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,050,000.000	6,377,203.120	
US T N/B 3.375 11/15/48	7,850,000.000	10,333,789.050	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,390,000.000	3,020,922.640	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,280,000.000	6,894,937.460	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,050,000.000	6,574,468.750	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,000,000.000	3,933,046.860	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	7,564,523.400	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	3,422,329.670	
US T N/B 4.25 05/15/39	3,000,000.000	4,143,750.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,320,000.000	4,610,909.350	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,890,000.000	2,628,576.560	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,770,000.000	3,903,535.930	
US T N/B 4.375 05/15/41	3,500,000.000	4,953,593.750	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,700,000.000	3,785,906.240	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,910,000.000	2,652,810.930	
US T N/B 4.5 05/15/38	2,140,000.000	3,018,904.670	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,567,729.670	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	4,031,550.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,470,000.000	5,125,569.510	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,450,000.000	2,130,253.890	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,134,429.670	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	3,073,609.370	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	2,168,889.050	
US T N/B 6.125 11/15/27	7,600,000.000	9,689,406.210	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,769,687.480	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,390,000.000	2,617,143.350	
アメリカ・ドル 小計	2,293,390,000.000 (260,437,368,400)	2,365,741,294.970 (268,653,581,459)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	3,680,000.000	3,632,528.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	7,920,000.000	7,872,934.600
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	2,970,000.000	2,899,606.830
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	3,000,000.000	2,979,803.400
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	5,960,000.000	5,697,886.350

UK TREASURY 0.375 10/22/26	3,380,000.000	3,354,064.580	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	3,740,000.000	3,648,766.440	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	2,730,000.000	2,710,092.210	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,960,000.000	2,785,093.600	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	2,110,000.000	2,128,637.630	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,920,000.000	2,815,586.640	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,430,000.000	1,350,012.090	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	3,400,000.000	3,426,728.760	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	2,000,000.000	1,967,540.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	3,560,000.000	3,597,914.000	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	3,840,000.000	3,922,556.920	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	5,000,000.000	5,078,785.000	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,220,000.000	1,256,478.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,000,000.000	3,126,480.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	960,000.000	1,054,404.670	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	3,890,000.000	4,110,446.300	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,170,000.000	3,321,976.140	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	5,160,000.000	5,861,140.800	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	1,678,167.900	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	860,000.000	923,382.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	2,200,000.000	2,707,320.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	4,520,000.000	6,609,279.600	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,790,000.000	3,374,449.200	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	3,720,000.000	4,854,786.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	4,760,000.000	5,337,987.760	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,750,000.000	2,910,039.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	4,130,000.000	4,267,486.040	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,770,000.000	6,405,003.800	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	7,000,000.000	7,449,246.000	

	UK TREASURY 3.25 01/22/44	6,200,000.000	9,083,806.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,130,000.000	6,344,382.100	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	3,490,000.000	7,489,121.200	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,930,000.000	3,439,453.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	3,360,000.000	7,036,982.400	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	4,190,000.000	6,091,681.780	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	3,650,000.000	4,938,577.020	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,720,000.000	4,218,420.800	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,280,000.000	3,998,418.400	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,190,000.000	5,046,516.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,360,000.000	4,111,946.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,990,000.000	5,494,244.600	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,280,000.000	6,646,624.800	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,640,000.000	3,813,652.120	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	4,010,000.000	6,766,474.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	4,100,000.000	5,566,660.200	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,560,000.000	5,740,998.400	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	3,650,000.000	4,184,698.710	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	1,991,676.500	
	イギリス・ボンド 小計	180,090,000.000 (27,112,549,500)	227,120,944.490 (34,193,058,193)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	5,500,000.000	5,522,396.000	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	5,760,000.000	5,796,040.320	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	3,670,000.000	3,691,326.370	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	3,230,000.000	3,266,340.730	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	5,710,000.000	5,559,393.040	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	6,230,000.000	6,403,661.250	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	3,500,000.000	3,682,616.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	5,650,000.000	6,090,490.950	

	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	4,620,000.000	5,105,039.940	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	9,070,000.000	9,817,485.910	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	5,370,000.000	7,096,954.410	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	1,280,000.000	1,349,835.520	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	4,390,000.000	7,120,198.070	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,250,000.000	2,880,261.000	
	イスラエル・シュケル 小計	66,230,000.000 (2,425,190,271)	73,382,039.510 (2,687,081,508)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	5,910,000.000	5,794,947.950	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	3,500,000.000	3,368,562.150	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	5,270,000.000	5,067,725.950	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	5,540,000.000	5,218,901.360	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	5,710,000.000	5,416,686.430	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	6,460,000.000	6,209,373.230	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,320,000.000	2,294,577.440	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	3,830,000.000	3,334,398.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	3,800,000.000	3,826,723.880	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,600,000.000	1,678,080.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	4,540,000.000	4,869,404.680	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	6,500,000.000	6,818,499.350	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,890,000.000	2,042,442.480	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,140,000.000	1,261,933.370	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	5,000,000.000	5,376,500.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,750,000.000	4,059,155.240	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	5,260,000.000	5,729,192.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,190,000.000	2,460,207.450	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	5,320,000.000	5,695,373.330	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	5,000,000.000	5,602,231.980	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	5,690,000.000	6,609,488.060		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,830,000.000	2,255,584.420		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,050,000.000	2,307,749.780		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	6,760,000.000	8,733,063.500		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	5,110,000.000	5,998,585.050		
	オーストラリア・ドル 小計	105,970,000.000 (8,624,898,300)	112,029,387.080 (9,118,071,814)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	30,000,000.000	29,917,350.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	16,600,000.000	16,619,090.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	9,500,000.000	9,303,800.770	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	35,500,000.000	35,487,575.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	22,500,000.000	22,553,887.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	9,500,000.000	9,615,235.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	9,500,000.000	9,764,081.950	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	6,700,000.000	6,895,772.660	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	4,450,000.000	4,687,935.270	
オフショア・人民元 小計		144,250,000.000 (2,570,361,900)	144,844,728.150 (2,580,959,242)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	1,950,000.000	1,938,691.950	
	CANADA 0.25 03/01/26	5,260,000.000	5,038,601.340	
	CANADA 0.25 04/01/24	6,750,000.000	6,628,371.750	
	CANADA 0.25 08/01/23	1,770,000.000	1,751,096.400	
	CANADA 0.5 09/01/25	7,260,000.000	7,064,343.000	
	CANADA 0.5 11/01/23	8,940,000.000	8,861,962.740	
	CANADA 0.5 12/01/30	4,500,000.000	4,140,958.500	
	CANADA 0.75 10/01/24	3,250,000.000	3,215,585.750	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,500,000.000	1,475,181.000	
	CANADA 1.0 09/01/26	4,710,000.000	4,639,387.680	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,200,000.000	2,204,114.000	
	CANADA 1.25 03/01/27	3,190,000.000	3,173,242.930	
	CANADA 1.25 06/01/30	7,990,000.000	7,889,333.990	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,110,000.000	3,138,972.760	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,400,000.000	1,413,412.000	
	CANADA 1.5 06/01/31	8,000,000.000	8,012,040.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	50,000.000	50,541.250	
	CANADA 1.5 12/01/31	5,140,000.000	5,122,750.160	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,490,000.000	1,507,260.160	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,700,000.000	1,663,354.800	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,670,000.000	1,738,630.320	
	CANADA 2.0 09/01/23	6,220,000.000	6,333,770.020	
	CANADA 2.0 12/01/51	8,410,000.000	8,776,751.690	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,660,000.000	3,756,894.840	
	CANADA 2.25 06/01/25	3,000,000.000	3,107,859.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	2,030,830.420	
	CANADA 2.5 06/01/24	20,000.000	20,689.780	
	CANADA 2.75 12/01/48	2,470,000.000	2,968,465.760	
	CANADA 2.75 12/01/64	2,190,000.000	2,739,057.090	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,270,000.000	3,021,678.720	
CANADA 4.0 06/01/41	1,640,000.000	2,240,207.200		
CANADA 5.0 06/01/37	1,190,000.000	1,720,769.750		
CANADA 5.75 06/01/29	1,440,000.000	1,887,095.520		
CANADA 5.75 06/01/33	2,240,000.000	3,205,325.760		
カナダ・ドル 小計		118,490,000.000 (10,578,787,200)	122,477,228.030 (10,934,766,919)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	1,300,000.000	1,264,770.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	1,000,000.000	995,158.020	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	1,640,000.000	1,585,060.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	610,000.000	595,634.500	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	1,700,000.000	1,740,375.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	2,150,000.000	2,224,605.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	1,440,000.000	1,496,628.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	1,230,000.000	1,281,660.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	780,000.000	828,360.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	2,450,000.000	2,610,475.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,330,000.000	1,512,210.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,230,000.000	1,385,472.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	2,280,000.000	2,350,039.540	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,530,000.000	1,661,886.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,200,000.000	1,311,600.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	2,250,000.000	2,371,703.620	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	2,020,000.000	2,337,140.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,760,000.000	1,940,048.000		
シンガポール・ドル 小計		27,900,000.000 (2,323,791,000)	29,492,824.680 (2,456,457,368)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	9,990,000.000	10,003,470.510	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	13,480,000.000	14,138,004.600	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	15,480,000.000	16,363,288.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	17,780,000.000	18,710,338.500	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	21,200,000.000	21,915,864.640	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	10,180,000.000	12,443,421.200	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	19,140,000.000	20,899,002.360	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	10,470,000.000	16,051,716.140	
スウェーデン・クローナ 小計		117,720,000.000 (1,475,031,600)	130,525,106.750 (1,635,479,588)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	7,530,000.000	7,650,931.800	
	DENMARK 0.0 11/15/31	7,060,000.000	7,130,616.930	
	DENMARK 0.25 11/15/52	11,810,000.000	12,190,518.200	
	DENMARK 0.5 11/15/27	18,550,000.000	19,481,395.500	
	DENMARK 0.5 11/15/29	22,820,000.000	24,157,252.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	12,900,000.000	13,432,305.600	
	DENMARK 1.75 11/15/25	10,950,000.000	11,912,980.230	
	DENMARK 4.5 11/15/39	26,920,000.000	49,029,396.000	
デンマーク・クローネ 小計		118,540,000.000 (2,047,185,800)	144,985,396.260 (2,503,897,793)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	6,050,000.000	5,922,042.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	12,460,000.000	12,352,158.700	
	NORWAY 1.5 02/19/26	9,370,000.000	9,413,203.170	
	NORWAY 1.75 02/17/27	9,840,000.000	10,001,966.400	
	NORWAY 1.75 03/13/25	19,330,000.000	19,583,223.000	

	NORWAY 1.75 09/06/29	8,410,000.000	8,576,686.200	
	NORWAY 2.0 04/26/28	10,810,000.000	11,167,270.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	4,550,000.000	4,611,789.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	24,640,000.000	25,619,932.800	
ノルウェー・クローネ 小計		105,460,000.000 (1,338,287,400)	107,248,272.270 (1,360,980,575)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	100,000.000	86,940.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	5,980,000.000	5,542,581.770	
	POLAND 04/25/23	7,310,000.000	7,026,006.500	
	POLAND 1.25 10/25/30	13,700,000.000	11,718,432.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	12,070,000.000	11,818,552.680	
	POLAND 2.5 01/25/23	660,000.000	657,822.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	9,750,000.000	9,641,648.150	
	POLAND 2.5 07/25/26	9,000,000.000	8,750,700.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	11,190,000.000	10,773,090.810	
	POLAND 2.75 04/25/28	11,960,000.000	11,646,050.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	4,224,840.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	9,190,000.000	9,223,748.420	
	POLAND 4.0 10/25/23	8,000,000.000	8,160,000.000	
ポーランド・ズロチ 小計		103,270,000.000 (2,870,751,095)	99,270,412.330 (2,759,568,557)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,490,000.000	2,311,481.760	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	3,330,000.000	3,393,113.150	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	2,110,000.000	2,143,106.530	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	5,090,000.000	5,167,329.810	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	5,550,000.000	5,287,945.260	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	1,070,000.000	1,097,113.370	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	9,650,000.000	9,619,307.010	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,900,000.000	1,916,294.200	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	3,000,000.000	3,100,971.300	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	5,910,000.000	6,053,693.360	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,417,452.690	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	5,370,000.000	5,547,501.590	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	4,140,000.000	4,285,460.550	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	4,810,000.000	4,974,476.980	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	7,840,000.000	8,131,723.260	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	7,100,000.000	7,354,674.850	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	5,020,000.000	4,936,660.010	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,480,000.000	2,566,099.640	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	5,200,000.000	5,442,018.400	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	4,560,000.000	4,739,916.620	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,030,000.000	3,195,492.230	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	3,050,000.000	3,254,640.960	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,400,000.000	2,584,744.560	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	1,700,000.000	1,797,616.380		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,730,000.000	4,053,142.580		
MALAYSIA 4.893 06/08/38	230,000.000	251,407.450		

	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,400,000.000	2,606,073.120	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,970,000.000	2,154,510.590	
マレーシア・リングgit 小計		106,500,000.000 (2,870,792,700)	109,383,968.210 (2,948,532,370)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	20,000,000.000	18,522,400.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	23,000,000.000	21,589,180.000	
	MEXICAN BONDS 03/09/23	3,630,000.000	3,645,209.700	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	18,223,000.000	22,292,571.290	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	58,893,000.000	63,529,127.610	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	112,504,000.000	106,979,198.560	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	54,445,000.000	55,169,559.480	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	70,710,000.000	72,723,113.700	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	37,918,000.000	37,728,271.960	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,011,000.000	16,441,535.790	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	50,550,000.000	51,733,881.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	44,626,000.000	45,437,398.850	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	68,133,000.000	69,475,015.700	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	67,501,000.000	72,325,930.950	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	59,673,000.000	63,890,168.470	
メキシコ・ペソ 小計		705,817,000.000 (3,839,432,735)	721,482,563.060 (3,924,648,698)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	2,720,000.000	2,761,591.520	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	3,090,000.000	3,120,156.540	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	20,000.000	20,183.300	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	2,210,000.000	2,100,605.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	740,000.000	744,884.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	790,000.000	834,456.460	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	4,010,000.000	4,214,368.030	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	4,840,000.000	5,178,528.960	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	500,000.000	549,059.500	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	5,830,000.000	6,181,269.160	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	1,710,000.000	1,710,718.200	
	AUSTRIA 07/15/24	3,070,000.000	3,121,594.420	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	2,200,000.000	2,351,998.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,890,000.000	2,434,594.050	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	3,680,000.000	3,927,358.560	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	8,090,000.000	8,462,868.100	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,420,000.000	2,471,419.120	

AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,960,000.000	2,541,479.080	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	590,000.000	971,446.500	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	1,060,000.000	2,331,436.180	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,260,000.000	5,268,486.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	60,000.000	82,882.800	
BELGIUM 0.0 10/22/27	800,000.000	819,611.200	
BELGIUM 0.0 10/22/31	2,190,000.000	2,195,954.610	
BELGIUM 0.1 06/22/30	3,100,000.000	3,172,230.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	4,500,000.000	4,576,275.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	2,630,000.000	2,613,512.000	
BELGIUM 0.5 10/22/24	3,000,000.000	3,102,399.000	
BELGIUM 0.65 06/22/71	2,770,000.000	2,532,113.920	
BELGIUM 0.8 06/22/25	4,720,000.000	4,955,368.450	
BELGIUM 0.8 06/22/27	3,060,000.000	3,270,772.800	
BELGIUM 0.8 06/22/28	3,000,000.000	3,227,250.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	3,900,000.000	4,247,595.300	
BELGIUM 1.0 06/22/26	5,000,000.000	5,346,267.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	5,110,000.000	5,651,046.800	
BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,746,202.400	
BELGIUM 1.45 06/22/37	500,000.000	587,303.500	
BELGIUM 1.6 06/22/47	3,190,000.000	3,940,654.850	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,890,000.000	2,406,293.190	
BELGIUM 1.9 06/22/38	2,770,000.000	3,478,737.740	
BELGIUM 2.15 06/22/66	1,340,000.000	1,995,796.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	700,000.000	1,031,371.600	
BELGIUM 2.6 06/22/24	5,720,000.000	6,201,235.040	
BELGIUM 3.0 06/22/34	2,140,000.000	2,911,898.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	890,000.000	1,527,336.120	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,950,000.000	2,774,922.150	
BELGIUM 4.25 03/28/41	5,050,000.000	8,630,374.250	
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,490,000.000	3,041,990.670	
BELGIUM 5.0 03/28/35	4,130,000.000	6,784,499.680	
BELGIUM 5.5 03/28/28	4,630,000.000	6,396,113.500	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	5,100,000.000	5,238,975.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	4,910,000.000	5,023,961.100	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	6,500,000.000	6,686,940.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	6,960,000.000	7,137,480.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,000,000.000	2,054,580.000	
BUNDESOBL 04/05/24	4,920,000.000	5,005,092.380	
BUNDESOBL 04/14/23	5,060,000.000	5,110,625.300	
BUNDESOBL 10/13/23	3,940,000.000	3,995,475.200	
BUNDESOBL 10/18/24	5,610,000.000	5,727,057.130	
BUNDESSCHAT 0.0 09/15/23	3,000,000.000	3,038,138.100	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	8,000,000.000	8,113,896.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	7,490,000.000	7,778,739.500	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	4,670,000.000	4,843,443.800	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	5,640,000.000	5,801,755.200	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	5,450,000.000	5,593,825.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	5,000,000.000	5,192,100.000	

DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,320,000.000	2,421,384.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,610,000.000	2,700,671.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	5,000,000.000	5,190,540.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	7,110,000.000	7,258,812.300	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,700,000.000	1,755,199.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,920,000.000	1,946,054.400	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	3,310,000.000	3,420,189.900	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	7,000,000.000	7,248,466.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,650,000.000	7,983,999.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	6,540,000.000	6,903,833.280	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	6,430,000.000	6,769,504.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	7,480,000.000	7,768,129.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	6,490,000.000	6,800,222.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	5,550,000.000	5,915,412.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	6,000,000.000	6,370,038.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	5,680,000.000	5,848,287.040	
DEUTSCHLAND 08/15/29	7,680,000.000	7,970,319.360	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	7,400,000.000	7,745,691.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	6,350,000.000	6,743,255.500	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	7,010,000.000	9,564,633.270	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	5,050,000.000	5,183,870.450	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	7,990,000.000	8,427,152.870	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	3,570,000.000	3,766,225.050	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	10,870,000.000	11,375,498.480	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	5,040,000.000	8,177,652.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	7,680,000.000	12,822,480.380	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	3,260,000.000	5,642,179.800	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	6,760,000.000	11,240,027.760	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	5,160,000.000	9,352,861.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,380,000.000	3,228,470.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,530,000.000	9,179,302.300	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,480,000.000	8,749,484.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	4,840,000.000	7,531,427.200	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,390,000.000	4,696,573.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,353,707.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,183,692.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,344,947.200	

FINLAND 0.0 09/15/24	1,230,000.000	1,252,838.270	
FINLAND 0.0 09/15/30	1,280,000.000	1,300,057.600	
FINLAND 0.125 04/15/36	180,000.000	180,175.320	
FINLAND 0.125 04/15/52	840,000.000	803,512.080	
FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	184,051.980	
FINLAND 0.25 09/15/40	1,720,000.000	1,743,659.450	
FINLAND 0.5 04/15/26	2,000,000.000	2,092,092.200	
FINLAND 0.5 09/15/27	2,310,000.000	2,435,871.900	
FINLAND 0.5 09/15/28	90,000.000	95,161.770	
FINLAND 0.5 09/15/29	1,560,000.000	1,655,133.480	
FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	1,063,962.480	
FINLAND 0.875 09/15/25	160,000.000	168,938.400	
FINLAND 09/15/23	2,750,000.000	2,782,447.250	
FINLAND 1.125 04/15/34	1,340,000.000	1,525,037.920	
FINLAND 1.375 04/15/47	1,430,000.000	1,853,101.810	
FINLAND 2.0 04/15/24	2,370,000.000	2,523,002.460	
FINLAND 2.625 07/04/42	780,000.000	1,174,662.840	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,340,000.000	1,620,944.400	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,240,000.000	1,447,680.160	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	4,660,000.000	4,700,868.200	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	7,000,000.000	7,101,826.900	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	9,050,000.000	9,234,710.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,000,000.000	4,082,520.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	9,760,000.000	9,912,158.400	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	12,180,000.000	12,294,340.960	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	10,570,000.000	10,578,329.160	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	10,000,000.000	10,345,615.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	11,400,000.000	11,819,976.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	9,220,000.000	9,621,116.100	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	9,550,000.000	10,081,572.100	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	4,460,000.000	4,536,725.380	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	2,000,000.000	1,735,718.000	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	3,930,000.000	3,951,241.650	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	13,000,000.000	13,917,072.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	8,780,000.000	9,016,515.640	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,100,000.000	1,120,650.300	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	11,980,000.000	12,858,972.600	
FRANCE OAT 03/25/23	10,160,000.000	10,251,175.840	
FRANCE OAT 03/25/24	10,810,000.000	10,973,231.000	
FRANCE OAT 03/25/25	11,000,000.000	11,204,160.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	8,780,000.000	9,461,240.200	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	9,000,000.000	9,544,635.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	11,060,000.000	12,560,565.500	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	10,990,000.000	12,546,184.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	12,910,000.000	14,846,616.190	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	7,470,000.000	9,222,447.060	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	9,640,000.000	9,982,798.400	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,390,000.000	3,271,886.100	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	7,230,000.000	9,036,487.800	

FRANCE OAT 1.75 11/25/24	12,090,000.000	12,940,059.990	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	6,730,000.000	9,142,429.070	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	13,080,000.000	14,016,528.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	11,550,000.000	14,201,233.200	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	11,550,000.000	13,718,489.400	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	6,330,000.000	10,223,292.440	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	12,050,000.000	14,172,607.500	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	4,230,000.000	8,472,690.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,520,000.000	7,438,393.600	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	5,520,000.000	8,939,590.320	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,000,000.000	2,186,126.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	9,920,000.000	17,602,325.760	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,890,000.000	9,506,448.220	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,380,000.000	11,996,975.600	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,090,000.000	13,192,160.750	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	2,793,636.900	
IRISH 0.0 10/18/31	930,000.000	925,595.980	
IRISH 0.2 05/15/27	140,000.000	144,012.470	
IRISH 0.2 10/18/30	1,660,000.000	1,696,853.990	
IRISH 0.4 05/15/35	2,300,000.000	2,342,897.750	
IRISH 0.55 04/22/41	350,000.000	354,934.120	
IRISH 0.9 05/15/28	2,790,000.000	3,000,315.780	
IRISH 1.0 05/15/26	2,430,000.000	2,586,487.140	
IRISH 1.1 05/15/29	3,330,000.000	3,641,710.280	
IRISH 1.35 03/18/31	1,420,000.000	1,606,704.440	
IRISH 1.5 05/15/50	1,890,000.000	2,299,548.820	
IRISH 1.7 05/15/37	1,660,000.000	2,001,974.940	
IRISH 2.0 02/18/45	2,250,000.000	2,998,917.000	
IRISH 2.4 05/15/30	2,610,000.000	3,169,393.470	
IRISH 3.4 03/18/24	2,790,000.000	3,047,311.360	
IRISH 3.9 03/20/23	110,000.000	116,308.430	
IRISH 5.4 03/13/25	3,680,000.000	4,397,165.760	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,850,000.000	1,861,285.000	
ITALY BTPS 0.0 01/30/24	4,000,000.000	4,019,200.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	7,000,000.000	6,961,500.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	4,700,000.000	4,720,210.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	4,000,000.000	3,962,800.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	10,000,000.000	10,041,000.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	4,610,000.000	4,549,148.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	3,710,000.000	3,756,746.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	5,200,000.000	5,276,122.800	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	5,000,000.000	4,949,500.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	4,100,000.000	4,172,262.500	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	5,500,000.000	5,497,800.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	4,500,000.000	4,573,935.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	3,810,000.000	3,704,950.790	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	3,840,000.000	3,914,784.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	5,390,000.000	5,554,934.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	7,770,000.000	7,796,852.330	

ITALY BTPS 0.95 03/01/37	3,450,000.000	3,280,950.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	2,000,000.000	1,984,600.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	4,750,000.000	4,816,975.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	5,100,000.000	5,269,830.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	5,780,000.000	5,781,641.520	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	6,030,000.000	6,345,224.280	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	5,000,000.000	5,255,330.000	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	5,000,000.000	5,140,500.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,620,000.000	1,704,103.920	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	4,690,000.000	4,910,542.560	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	2,130,000.000	2,055,663.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	4,010,000.000	4,227,049.270	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	5,790,000.000	6,171,561.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	4,780,000.000	5,107,386.980	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	6,000,000.000	6,431,046.000	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	3,400,000.000	3,345,229.400	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,630,000.000	4,861,939.850	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	3,510,000.000	3,668,652.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	7,000,000.000	7,356,300.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	4,670,000.000	4,980,088.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	7,000,000.000	7,679,994.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	5,610,000.000	6,051,209.670	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	4,000,000.000	4,384,200.000	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	4,540,000.000	4,948,822.460	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	1,357,644.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	4,000,000.000	4,411,600.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	4,130,000.000	4,674,334.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	5,310,000.000	6,108,624.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	3,480,000.000	3,984,600.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	6,560,000.000	6,896,845.500	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	4,000,000.000	4,391,552.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,090,000.000	4,411,793.020	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	4,030,000.000	4,858,165.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,600,000.000	1,867,360.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	4,660,000.000	5,391,825.040	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	4,970,000.000	6,098,687.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,790,000.000	5,647,055.540	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	7,000,000.000	8,829,807.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	4,270,000.000	5,617,693.130	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	4,170,000.000	5,258,774.490	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	3,660,000.000	5,004,954.840	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,860,000.000	7,187,547.840	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	8,500,000.000	9,414,863.500	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	2,500,000.000	3,661,525.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	5,720,000.000	7,835,256.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	5,190,000.000	5,743,285.140	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	6,220,000.000	7,381,896.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,830,000.000	6,328,639.900	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	5,660,000.000	7,254,948.380	

ITALY BTPS 4.75 09/01/44	4,780,000.000	7,653,779.020	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,820,000.000	4,448,149.340	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,550,000.000	3,703,620.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,300,000.000	3,584,320.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,670,000.000	5,805,940.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,940,000.000	6,715,436.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,690,000.000	5,548,653.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,318,850.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,612,440.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	5,260,000.000	5,398,338.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	2,370,000.000	2,431,319.950	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	3,510,000.000	3,524,566.500	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	3,760,000.000	3,677,953.040	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	3,640,000.000	3,735,411.680	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	2,480,000.000	2,533,936.520	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	6,880,000.000	7,092,253.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	2,830,000.000	2,963,771.270	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	2,970,000.000	3,279,275.010	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	2,000,000.000	2,100,700.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	5,330,000.000	5,710,967.080	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	3,080,000.000	3,328,257.240	
NETHERLANDS 01/15/24	6,540,000.000	6,634,771.140	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,060,000.000	1,102,872.760	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	7,750,000.000	8,290,373.400	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,620,000.000	4,709,201.500	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	4,290,000.000	7,276,269.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,530,000.000	4,473,804.060	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,060,000.000	4,968,522.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	980,000.000	1,343,912.220	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	90,000.000	98,100.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	4,920,000.000	4,984,206.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	5,690,000.000	5,757,932.910	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,000,000.000	1,007,600.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	3,000,000.000	3,000,000.000	
SPAIN 0.0 04/30/23	1,430,000.000	1,441,811.800	
SPAIN 0.0 05/31/24	6,940,000.000	7,016,549.580	
SPAIN 0.1 04/30/31	6,890,000.000	6,770,251.800	
SPAIN 0.25 07/30/24	8,470,000.000	8,628,067.140	
SPAIN 0.35 07/30/23	270,000.000	274,122.630	
SPAIN 0.5 04/30/30	6,040,000.000	6,212,411.800	
SPAIN 0.5 10/31/31	7,000,000.000	7,104,132.000	
SPAIN 0.6 10/31/29	6,030,000.000	6,266,207.160	

	SPAIN 0.8 07/30/27	5,000,000.000	5,238,750.000	
	SPAIN 0.85 07/30/37	1,810,000.000	1,830,968.850	
	SPAIN 1.0 07/30/42	2,000,000.000	2,036,400.000	
	SPAIN 1.0 10/31/50	4,270,000.000	4,144,594.370	
	SPAIN 1.2 10/31/40	4,110,000.000	4,335,897.930	
	SPAIN 1.25 10/31/30	6,470,000.000	7,049,065.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	6,390,000.000	6,880,081.050	
	SPAIN 1.4 04/30/28	5,240,000.000	5,717,966.600	
	SPAIN 1.4 07/30/28	6,200,000.000	6,784,660.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	6,930,000.000	7,641,537.750	
	SPAIN 1.45 10/31/27	5,390,000.000	5,880,608.580	
	SPAIN 1.45 10/31/71	1,730,000.000	1,641,475.900	
	SPAIN 1.5 04/30/27	4,340,000.000	4,733,421.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	4,000,000.000	4,275,724.000	
	SPAIN 1.85 07/30/35	4,870,000.000	5,653,670.660	
	SPAIN 1.95 04/30/26	4,170,000.000	4,580,845.080	
	SPAIN 1.95 07/30/30	5,660,000.000	6,520,328.480	
	SPAIN 2.15 10/31/25	5,460,000.000	5,998,716.360	
	SPAIN 2.35 07/30/33	4,290,000.000	5,180,175.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	4,020,000.000	5,575,149.060	
	SPAIN 2.75 10/31/24	6,860,000.000	7,508,171.210	
	SPAIN 2.9 10/31/46	4,770,000.000	6,782,625.180	
	SPAIN 3.45 07/30/66	2,440,000.000	3,950,255.080	
	SPAIN 3.8 04/30/24	7,670,000.000	8,470,893.730	
	SPAIN 4.2 01/31/37	2,990,000.000	4,534,468.040	
	SPAIN 4.4 10/31/23	4,750,000.000	5,202,109.750	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,310,000.000	6,290,178.210	
	SPAIN 4.7 07/30/41	5,720,000.000	9,754,047.160	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,840,000.000	4,283,923.200	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,360,000.000	7,475,220.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	4,700,000.000	6,363,800.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	2,530,000.000	4,747,863.780	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,480,000.000	2,650,519.840	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,510,000.000	8,631,150.520	
	SPAIN 5.9 07/30/26	5,590,000.000	7,202,852.510	
	SPAIN 6.0 01/31/29	820,000.000	1,173,526.600	
	ユーロ 小計	1,485,290,000.000 (190,726,088,900)	1,710,997,435.410 (219,709,180,681)	
国債証券	合計	519,240,516,800.900 (519,240,516,801)	565,466,264,765 (565,466,264,765)	
合計			565,466,264,765 (565,466,264,765)	

(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 241銘柄	46.99	47.51
イギリス・ポンド	国債証券 53銘柄	5.98	6.05
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.47	0.48
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	1.59	1.61
オフショア・人民元	国債証券 9銘柄	0.45	0.46
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	1.91	1.93
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.43	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.29	0.29
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.44	0.44
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.24	0.24
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.48	0.49
マレーシア・リングgit	国債証券 28銘柄	0.52	0.52
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.69	0.69
ユーロ	国債証券 328銘柄	38.43	38.85

(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)

2021年12月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,084,142,512
コール・ローン	150,158,498
投資信託受益証券	6,652,683,463
投資証券	58,821,181,126
派生商品評価勘定	391
未収入金	3,628,092
未収配当金	113,309,097
流動資産合計	74,825,103,179
資産合計	74,825,103,179
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,160
未払金	9,000,077,914
未払解約金	3,689,000
流動負債合計	9,003,768,074
負債合計	9,003,768,074
純資産の部	
元本等	
元本	38,794,144,690
剰余金	
剰余金又は欠損金()	27,027,190,415
元本等合計	65,821,335,105
純資産合計	65,821,335,105
負債純資産合計	74,825,103,179

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13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	2021年12月13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	51,655,828,732円
同期中追加設定元本額	51,216,116,529円
同期中一部解約元本額	64,077,800,571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)	85,904,815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)	54,668,763円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,826,902円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	18,315,479円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	51,701,549円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	35,330,801円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	20,993,445円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	18,976,156円
たわらノーロード 先進国リート	10,484,061,604円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,529,526,917円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	368,451,748円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,874,988,709円
たわらノーロード バランス(堅実型)	17,917,693円

たわらノーロード バランス(標準型)	337,017,762円
たわらノーロード バランス(積極型)	658,714,257円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	2,849,915円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	55,830,771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)	142,624,276円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	270,249,225円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	8,171,307円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,951,014円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,111,839円
One DC 先進国リートインデックスファンド	825,494,393円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,050,217円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	597,353,268円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	49,790,786円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	192,247,956円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	249,344,087円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	475,687,829円
投資のソムリエ	7,558,775,172円
投資のソムリエ<DC年金>	386,407,034円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	187,810,335円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	256,126,981円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,311,553,212円
ワールドアセットバランス(基本コース)	503,303,736円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,388,123,215円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	22,981,545円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,171,278円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,614,052円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	56,609,669円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,975,794,374円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	166,440,186円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	18,131,147円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,227,224円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,791,984円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	411,800円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	336,442,988円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	189,566,086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)	124,500,248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)	243,630,846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)	127,897,472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)	95,389,940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)	77,537,996円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	61,079,208円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	122,922,453円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	563,418,602円

インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	122,514,398円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	203,850,131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）	208,972,224円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	4,175,571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）	95,071,647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）	227,483,822円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,885,130,374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）	340,995,307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）	437,011,975円
計	38,794,144,690円
2. 受益権の総数	38,794,144,690口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年12月13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	212,851,871	
投資証券	2,127,520,762	
合計	2,340,372,633	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年6月23日から2021年12月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年12月13日現在			
	契約額等（円）	うち		評価損益（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
買建				
アメリカ・ドル	103,892,223	-	103,891,454	769
イギリス・ポンド	56,779,950	-	56,778,850	1,100
オーストラリア・ドル	13,549,275	-	13,549,383	108
カナダ・ドル	20,347,000	-	20,347,175	175
ユーロ	1,785,566	-	1,785,588	22
香港・ドル	7,062,552	-	7,062,638	86
香港・ドル	4,367,880	-	4,367,820	60
合計	103,892,223	-	103,891,454	769

（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）

	2021年12月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6967円 (16,967円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年12月13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	240,000.000	189,600.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	536,000.000	351,080.000		
		PRIME US REIT	146,400.000	120,780.000		
		アメリカ・ドル	小計	995,100.000	661,460.000 (75,115,398)	
	オーストラリア・ドル	ア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	139,392.000	490,659.840	
			ARENA REIT	111,683.000	504,807.160	
			AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	133,678.000	462,525.880	
			BWP TRUST	175,879.000	729,897.850	
			CENTURIA CAPITAL GROUP	230,635.000	763,401.850	
			CENTURIA INDUSTRIAL REIT	195,751.000	767,343.920	
			CENTURIA OFFICE REIT	145,409.000	341,711.150	
			CHARTER HALL GROUP	166,376.000	3,284,262.240	
			CHARTER HALL LONG WALE REIT	218,950.000	1,101,318.500	
CHARTER HALL RETAIL REIT			188,345.000	785,398.650		
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	122,893.000	481,740.560		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	524,957.000	454,087.800		
		DEXUS	383,663.000	4,224,129.630		

	DEXUS INDUSTRIA REIT	92,852.000	320,339.400	
	GDI PROPERTY GROUP	175,295.000	197,206.870	
	GOODMAN GROUP	597,636.000	15,126,167.160	
	GPT GROUP	683,924.000	3,549,565.560	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	80,320.000	332,524.800	
	HOME CONSORTIUM LTD	59,578.000	476,028.220	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	134,504.000	199,738.440	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	59,778.000	207,429.660	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	132,717.000	812,228.040	
	IRONGATE GROUP	174,249.000	276,184.660	
	MIRVAC GROUP	1,406,572.000	4,107,190.240	
	NATIONAL STORAGE REIT	343,798.000	856,057.020	
	RURAL FUNDS GROUP	125,125.000	392,892.500	
	SCENTRE GROUP	1,849,151.000	5,787,842.630	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	390,535.000	1,116,930.100	
	STOCKLAND	852,182.000	3,689,948.060	
	VICINITY CENTRES	1,385,219.000	2,417,207.150	
	WAYPOINT REIT LTD	268,896.000	726,019.200	
	オーストラリア・ドル 小計	11,549,942.000	54,982,784.740 (4,475,048,850)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	153,995.000	217,132.950	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	432,380.000	382,656.300	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,198,060.000	3,546,257.600	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	673,416.000	673,416.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	337,780.000	395,202.600	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,780,709.000	3,614,839.270	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	287,200.000	336,024.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	77,000.000	61,985.000	
	ESR REIT	1,035,130.000	496,862.400	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	355,500.000	216,855.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	296,300.000	88,890.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	388,700.000	878,462.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,044,264.000	1,587,281.280	
	IREIT GLOBAL	186,300.000	119,232.000	
	KEPPEL DC REIT	454,800.000	1,086,972.000	
	KEPPEL REIT	710,600.000	817,190.000	

		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	337,300.000	290,078.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	787,900.000	1,615,195.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	696,620.000	1,880,874.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,070,320.000	2,033,608.000	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	787,300.000	810,919.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	782,855.000	340,541.920	
		PARKWAY LIFE REIT	141,400.000	716,898.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	171,400.000	147,404.000	
		SPH REIT	313,700.000	308,994.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	464,400.000	294,894.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	781,790.000	1,164,867.100	
	シンガポール・ドル	小計	15,747,119.000	24,123,531.920 (2,009,248,974)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	100,540.000	256,377.000	
	ユーロ	小計	100,540.000	256,377.000 (32,921,371)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	524,000.000	4,144,840.000	
	香港・ドル	小計	524,000.000	4,144,840.000 (60,348,870)	
投資信託受益証券 合計			28,916,701	6,652,683,463 (6,652,683,463)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	32,223.000	689,572.200	
		AGREE REALTY CORP	24,672.000	1,677,696.000	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	26,474.000	640,670.800	
		ALEXANDER'S INC.	821.000	212,228.500	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	49,291.000	10,446,734.540	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,917.000	93,423.000	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	19,175.000	685,698.000	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	49,648.000	2,702,340.640	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	43,526.000	366,924.180	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	97,574.000	4,044,442.300	
		AMERICOLD REALTY TRUST	93,122.000	3,013,427.920	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	55,998.000	2,927,575.440	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	48,548.000	380,130.840	

APPLE HOSPITALITY REIT INC	76,295.000	1,194,016.750	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	19,920.000	295,413.600	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,844.000	70,493.200	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	49,879.000	12,213,870.730	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	7,823.000	109,365.540	
BOSTON PROPERTIES INC	50,576.000	5,770,721.600	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	24,777.000	118,186.290	
BRANDYWINE REALTY TRUST	61,716.000	831,931.680	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	106,021.000	2,538,142.740	
BROADSTONE NET LEASE INC	56,949.000	1,435,684.290	
BRT APARTMENTS CORP	4,397.000	84,642.250	
CAMDEN PROPERTY TRUST	35,789.000	6,216,191.410	
CARETRUST REIT INC	35,090.000	739,697.200	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,605.000	60,123.400	
CENTERSPACE	5,144.000	545,572.640	
CHATHAM LODGING TRUST	18,416.000	239,408.000	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	4,068.000	29,859.120	
CITY OFFICE REIT INC	13,569.000	243,020.790	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	45,723.140	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,564.000	381,098.000	
COREPOINT LODGING INC	15,054.000	233,638.080	
CORESITE REALTY CORP	15,779.000	2,683,218.950	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	40,400.000	1,090,800.000	
COUSINS PROPERTIES INC	53,151.000	2,093,086.380	
CTO REALTY GROUTH INC	2,436.000	133,517.160	
CUBESMART	76,685.000	4,164,762.350	
CYRUSONE INC	44,191.000	3,950,233.490	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	76,703.000	711,803.840	
DIGITAL REALTY TRUST INC	100,925.000	16,864,567.500	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	176,603.000	1,421,654.150	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	73,870.000	200,926.400	
DOUGLAS EMMETT INC	62,713.000	2,092,732.810	
DUKE REALTY TRUST	134,551.000	8,286,996.090	
EAST GROUP	14,413.000	3,084,958.520	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	30,610.000	674,950.500	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	45,564.000	420,555.720	

EPR PROPERTIES	26,858.000	1,268,234.760	
EQUINIX INC	32,044.000	25,567,587.160	
EQUITY COMMONWEALTH	43,855.000	1,111,285.700	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	60,842.000	5,175,220.520	
EQUITY RESIDENTIAL	121,139.000	10,522,133.540	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	42,488.000	1,161,197.040	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	23,130.000	7,995,578.400	
EXTRA SPACE STORAGE INC	47,573.000	9,928,960.830	
FARMLAND PARTNERS INC	11,176.000	132,547.360	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,958.000	3,252,276.980	
FIRST INDUSTRIAL RT	46,071.000	2,921,362.110	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	27,555.000	775,122.150	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	31,101.000	197,180.340	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	79,331.000	3,678,578.470	
GEO GROUP INC	37,980.000	273,835.800	
GETTY REALTY CORP	12,566.000	397,588.240	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,521.000	263,370.060	
GLADSTONE LAND CORP	10,656.000	326,606.400	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	22,278.000	370,037.580	
GLOBAL NET LEASE INC	36,739.000	558,065.410	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	52,113.000	1,654,066.620	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	78,115.000	2,639,505.850	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	191,761.000	6,479,604.190	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,382.000	86,126.760	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	37,323.000	1,652,662.440	
HOST HOTELS & RESORTS INC	254,327.000	4,229,458.010	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	54,686.000	1,384,102.660	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	37,887.000	927,852.630	
INDUS REALTY TRUST INC	1,685.000	129,593.350	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	23,942.000	550,426.580	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,550.000	2,182,473.000	
INVITATION HOMES INC	204,995.000	8,759,436.350	
IRON MOUNTAIN INC	103,065.000	4,990,407.300	
JBG SMITH PROPERTIES	41,724.000	1,174,113.360	

KILROY REALTY CORP	37,417.000	2,526,021.670	
KIMCO REALTY	218,420.000	5,014,923.200	
KITE REALTY GROUP TRUST	78,188.000	1,658,367.480	
LEXINGTON REALTY TRUST	99,521.000	1,516,700.040	
LIFE STORAGE INC	27,906.000	3,908,514.360	
LTC PROPERTIES INC	12,691.000	416,010.980	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	212,135.000	4,633,028.400	
MID AMERICA	41,255.000	8,930,469.850	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	35,592.000	744,228.720	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,536.000	910,802.880	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	62,652.000	2,846,906.880	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	29,181.000	1,847,157.300	
NETSTREIT CORP	14,684.000	317,468.080	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,262.000	645,179.580	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	15,634.000	376,466.720	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	85,310.000	2,389,533.100	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,151.000	208,703.430	
ORION OFFICE REIT INC	20,322.000	385,305.120	
PARAMOUNT GROUP INC	59,928.000	517,777.920	
PARK HOTELS & RESORTS INC	84,725.000	1,555,551.000	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	47,285.000	1,036,487.200	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,075.000	31,110.250	
PHYSICIANS REALTY TRUST	77,966.000	1,418,981.200	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	44,842.000	812,537.040	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,390.000	307,855.700	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,941.000	105,512.160	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	19,752.000	276,528.000	
PROLOGIS INC	263,881.000	41,978,189.480	
PS BUSINESS PARKS	7,219.000	1,279,495.560	
PUBLIC STORAGE	54,441.000	18,945,468.000	
REALTY INCOME CORP	196,807.000	13,174,260.580	
REGENCY CENTERS CORP	54,472.000	3,991,163.440	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	43,879.000	819,659.720	
RETAIL VALUE INC	7,197.000	45,053.220	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	49,092.000	3,687,300.120	

	RLJ LODGING TRUST	60,223.000	806,988.200	
	RPT REALTY	29,879.000	393,506.430	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,725.000	1,603,050.750	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	79,448.000	1,062,219.760	
	SAFEHOLD INC	4,929.000	352,522.080	
	SAUL CENTERS INC	4,909.000	250,555.360	
	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	13,967.000	190,370.210	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	60,374.000	554,837.060	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	117,354.000	17,887,096.680	
	SITE CENTERS CORP	64,602.000	986,472.540	
	SL GREEN	24,033.000	1,808,723.580	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	42,591.000	2,003,906.550	
	STAG INDUSTRIAL INC	57,850.000	2,575,482.000	
	STORE CAPITAL CORP	87,227.000	2,947,400.330	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	39,304.000	371,422.800	
	SUN COMMUNITIES INC	41,218.000	8,209,801.240	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	79,001.000	908,511.500	
	TANGER FACTORY OUTLET	37,599.000	740,700.300	
	TERRENO REALTY CORP	25,217.000	1,998,951.590	
	THE MACERICH COMPANY	76,394.000	1,363,632.900	
	UDR INC	99,307.000	5,797,542.660	
	UMH PROPERTIES INC	16,233.000	400,305.780	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,817.000	283,962.150	
	URBAN EDGE PROPERTIES	39,869.000	719,236.760	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,412.000	224,359.920	
	VENTAS INC	139,976.000	6,770,639.120	
	VERIS RESIDENTIAL INC	29,202.000	534,104.580	
	VICI PROPERTIES INC	218,463.000	6,195,610.680	
	VORNADO REALTY TRUST	56,782.000	2,387,115.280	
	WASHINGTON REIT	30,601.000	776,653.380	
	WELLTOWER INC	150,956.000	12,485,570.760	
	WHITESTONE REIT	17,016.000	164,034.240	
	WP CAREY INC	65,601.000	5,198,879.250	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	41,371.000	711,994.910	
アメリカ・ドル	小計	7,918,780.000	440,793,906.330 (50,056,556,003)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	50,845.000	57,251.470	
	ASSURA PLC	966,036.000	666,564.840	
	BIG YELLOW GROUP PLC	62,000.000	1,036,640.000	

BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	259,331.000	259,331.000	
BRITISH LAND CO PLC	335,080.000	1,740,405.520	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	308,741.000	494,603.080	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	232,486.000	226,441.360	
CUSTODIAN REIT PLC	128,342.000	129,625.420	
DERWENT LONDON PLC	40,147.000	1,345,727.440	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	200,205.000	168,172.200	
GCP STUDENT LIVING PLC	167,504.000	356,783.520	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	91,618.000	662,856.230	
HAMMERSON PLC	1,525,487.000	497,308.760	
HOME REIT PLC	94,904.000	114,359.320	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	107,234.000	127,393.990	
INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
LAND SECURITIES GROUP PLC	268,186.000	2,014,613.230	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	327,151.000	895,739.430	
LXI REIT PLC	255,851.000	373,542.460	
NEWRIVER REIT PLC	123,080.000	106,464.200	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	180,816.000	180,273.550	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	479,463.000	729,263.220	
PRS REIT PLC/THE	154,451.000	164,490.310	
REGIONAL REIT LTD	165,264.000	150,886.030	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	75,641.000	1,030,986.830	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	189,527.000	97,985.450	
SEGRO PLC	426,887.000	6,014,837.830	
SHAFTESBURY PLC	104,076.000	629,139.420	
STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	120,878.000	92,592.540	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	296,727.000	359,039.670	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	143,052.000	140,047.900	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	615,457.000	1,468,480.400	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	280,614.000	214,950.320	
UNITE GROUP PLC	142,629.000	1,555,369.240	
WORKSPACE GROUP PLC	46,948.000	389,198.920	
イギリス・ボンド 小計	9,197,698.000	24,491,365.100 (3,687,175,016)	

イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	63,187.000	1,336,405.050	
イスラエル・シュケル 小計		63,187.000	1,336,405.050 (48,936,079)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	22,560.000	984,067.200	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,292.000	237,405.800	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,036.000	69,245.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,436.000	461,027.400	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,692.000	26,701.080	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	30,349.000	1,722,912.730	
	CHOICE PROPERTIES REIT	58,139.000	836,038.820	
	COMINAR REAL ESTATE INVTR	29,354.000	335,222.680	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	15,780.000	278,990.400	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,097.000	286,887.660	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	40,273.000	666,115.420	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,627.000	218,532.900	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,129.000	61,319.860	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	39,192.000	681,156.960	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,606.000	1,181,374.740	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	51,308.000	803,996.360	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	42,994.180	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	25,307.000	420,096.200	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,027.000	451,809.120	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,091.000	110,932.890	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7,850.000	135,569.500		
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,028.000	37,214.120		
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	39,149.000	526,945.540		
PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	93,986.160		

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	56,026.000	1,232,572.000	
	SLATE GROCERY REIT	5,498.000	74,168.020	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	57,588.300	
	SMARTCENTRES REIT	25,748.000	796,128.160	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	30,047.000	676,057.500	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	13,342.000	96,862.920	
カナダ・ドル 小計		648,871.000	13,603,919.620 (1,214,557,944)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	313,249.000	482,403.460	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	380,281.000	996,336.220	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	538,822.000	638,504.070	
	PRECINCT PROPERTIES	443,539.000	709,662.400	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	122,708.000	373,645.860	
ニュージーランド・ドル 小計		1,798,599.000	3,200,552.010 (247,146,626)	
ユーロ	AEDIFICA	12,919.000	1,470,182.200	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	63,861.000	1,247,205.330	
	ALTAREA	1,333.000	211,947.000	
	BEFIMMO	8,000.000	265,600.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	8,509.000	219,106.750	
	CARMILA SA	16,304.000	213,908.480	
	COFINIMMO SA	10,011.000	1,382,519.100	
	COIMA RES SPA	6,479.000	47,102.330	
	COVIVIO	16,969.000	1,201,065.820	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,742.000	264,412.510	
	GECINA SA	19,399.000	2,271,622.900	
	HAMBORNER REIT AG	23,778.000	225,891.000	
	HIBERNIA REIT PLC	245,121.000	311,303.670	
	ICADE	11,571.000	716,244.900	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	21,702.000	77,042.100	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	94,465.000	760,443.250	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,866.000	246,918.100	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	140,654.000	222,795.930	
	KLEPIERRE	70,758.000	1,369,167.300	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	18,820.000	95,982.000	
MERCIALYS	18,400.000	151,616.000		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	119,732.000	1,176,247.160		
MONTEA SCA	3,727.000	477,056.000		

	NSI NV	5,868.000	203,619.600	
	RETAIL ESTATES	4,010.000	278,695.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	41,536.000	2,507,943.680	
	VASTNED RETAIL	5,647.000	130,445.700	
	WAREHOUSES DE PAUW	49,962.000	2,018,464.800	
	WERELDHAVE NV	15,344.000	184,588.320	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	6,702.000	321,360.900	
ユーロ 小計		1,085,189.000	20,270,497.830 (2,602,934,626)	
韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	54,887.000	349,630,190.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,512.000	54,598,880.000	
	JR REIT XXVII	38,156.000	204,897,720.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11,737.000	74,882,060.000	
	LOTTE REIT CO LTD	40,659.000	224,844,270.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	36,552.000	173,073,720.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,911.000	110,175,120.000	
韓国・ウォン 小計		205,414.000	1,192,101,960.000 (114,918,629)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	701,070.000	2,839,333.500	
	LINK REIT	744,320.000	50,353,248.000	
	PROSPERITY REIT	380,000.000	1,151,400.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	279,000.000	1,199,700.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	825,000.000	2,763,750.000	
香港・ドル 小計		2,929,390.000	58,307,431.500 (848,956,203)	
投資証券 合計		23,847,128	58,821,181,126 (58,821,181,126)	
合計			65,473,864,589 (65,473,864,589)	

(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	0.11	-	76.57
	投資証券 152銘柄	-	76.05	
イギリス・ポンド	投資証券 35銘柄	-	5.60	5.63

イスラエル・シケル	投資証券	1銘柄	-	0.07	0.07
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	31銘柄	6.80	-	6.83
カナダ・ドル	投資証券	30銘柄	-	1.85	1.86
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	27銘柄	3.05	-	3.07
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	-	0.38	0.38
ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	0.05	-	4.03
	投資証券	30銘柄	-	3.95	
韓国・ウォン	投資証券	7銘柄	-	0.17	0.18
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.09	-	1.39
	投資証券	5銘柄	-	1.29	

(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)

2021年12月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,021,507,614
コール・ローン	165,271,295
株式	61,283,626,357
新株予約権証券	166,591
投資信託受益証券	361,054,240
投資証券	43,807,914
派生商品評価勘定	13,611,247
未収入金	77,760,297
未収配当金	65,753,468
差入委託証拠金	1,692,792,992
流動資産合計	68,725,352,015
資産合計	68,725,352,015
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	40,459,176
未払解約金	3,371,000
流動負債合計	43,830,176
負債合計	43,830,176
純資産の部	
元本等	
元本	47,607,871,422
剰余金	
剰余金又は欠損金()	21,073,650,417
元本等合計	68,681,521,839
純資産合計	68,681,521,839
負債純資産合計	68,725,352,015

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年12月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	40,143,019,383円
同期中追加設定元本額	22,758,318,615円
同期中一部解約元本額	15,293,466,576円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	7,872,325,572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)	329,231,557円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,308,112円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,998,802円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	30,517,329円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,135,744円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	12,585,499円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,333,858円
たわらノーロード 新興国株式	8,529,550,475円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,693,172,866円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,203,207,503円
たわらノーロード バランス(堅実型)	21,280,150円
たわらノーロード バランス(標準型)	78,728,136円
たわらノーロード バランス(積極型)	129,354,991円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	93,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	82,368,250円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	264,352,744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)	168,733,912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)	280,218,052円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	506,605円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,666,902円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,745,299円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,847,670円
たわらノーロード 全世界株式	106,274,113円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	364,393,917円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	336,477,380円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	329,145,943円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	446,837,615円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	904,311,197円
投資のソムリエ	11,463,451,056円
クルーズコントロール	451,528,761円
投資のソムリエ< D C 年金>	284,722,223円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	360,110,426円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	4,523,462円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	24,069,054円
投資のソムリエ< D C 年金>リスク抑制型	215,277,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,002,351,081円
ワールドアセットバランス(基本コース)	833,770,619円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,426,877,897円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	50,468,723円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	26,723,647円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	2,173,612円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	44,029,644円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,205,920,702円
9資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	322,007,086円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	37,718,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	20,255,670円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	16,853,007円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	914,422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)	13,408,711円

投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	150,694,445円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,059,315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)	269,327,866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)	130,930,639円
計	47,607,871,422円
2. 受益権の総数	47,607,871,422口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年12月13日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	3,465,098,572	
新株予約権証券	166,591	
投資信託受益証券	59,076,029	
投資証券	2,993,501	
合計	3,527,001,511	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年4月20日から2021年12月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年12月13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	2,844	-	2,832	12	
ブラジル・リアル	2,844	-	2,832	12	
買建	60,590,484	-	60,642,636	52,152	
アメリカ・ドル	60,590,484	-	60,642,636	52,152	
合計	60,593,328	-	60,645,468	52,164	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2021年12月13日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	7,009,017,454	-	6,982,117,361	26,900,093
合計	7,009,017,454	-	6,982,117,361	26,900,093

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年12月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4427円 (14,427円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年12月13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	33,540	26.010	872,375.400	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,584	7.090	131,760.560	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	5.226	126,521.460	
	CREDICORP LTD	4,331	112.370	486,674.470	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	29,585	7.860	232,538.100	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,926	60.460	358,285.960	
	LUKOIL SPON ADR	29,079	89.640	2,606,641.560	
	GAZPROM PAO ADR	410,041	8.988	3,685,448.500	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	128,421	3.240	416,084.040	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,388	0.918	88,484.180	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	31,100	4.888	152,016.800	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	57,784	5.165	298,454.360	

51JOB INC ADR	2,101	49.890	104,818.890	
X5 RETAIL GROUP NV GDR	8,354	28.550	238,506.700	
NOVATEK PJSC GDR	6,291	228.800	1,439,380.800	
BAIDU INC -SPON ADR	18,735	149.340	2,797,884.900	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	28.860	382,683.600	
MMC NORILSK NICKEL ADR	45,925	29.710	1,364,431.750	
ROSNEFT OIL CO GDR	90,405	7.708	696,841.740	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	127,330	2.300	292,859.000	
SEVERSTAL GDR	18,608	21.760	404,910.080	
TATNEFT ADR	16,642	39.470	656,859.740	
VTB BANK OJSC GDR	152,000	1.200	182,400.000	
MAGNIT PJSC GDR	29,277	15.775	461,844.670	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	36,039	9.330	336,243.870	
VNET GROUP INC ADR	8,615	8.510	73,313.650	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	5.060	124,617.680	
MAIL.RU GROUP LTD GDR	9,858	13.420	132,294.360	
YANDEX NV	20,883	63.350	1,322,938.050	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	3,513	34.990	122,919.870	
SBERBANK ADR	189,038	16.085	3,040,676.230	
PHOSAGRO PJSC GDR	11,773	20.800	244,878.400	
HUAZHU GROUP LTD ADR	11,331	40.310	456,752.610	
JOYY INC-ADR	5,086	50.910	258,928.260	
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	4,640	43.490	201,793.600	
GDS HOLDINGS LTD ADR	4,965	52.690	261,605.850	
ZAI LAB LTD ADR	5,960	65.510	390,439.600	
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	8,124	85.880	697,689.120	
360 DIGITECH INC ADR	5,813	23.700	137,768.100	
BILIBILI INC ADR	10,696	59.130	632,454.480	
NIO INC ADR	92,389	34.260	3,165,247.140	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	40,762	6.780	276,366.360	
AUTOHOME INC ADR	6,296	32.550	204,934.800	
I-MAB ADR	3,403	53.420	181,788.260	
WEIBO CORP ADR	4,386	31.650	138,816.900	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	2,911	16.170	47,070.870	
KANZHUN LTD ADR	5,650	39.180	221,367.000	
RLX TECHNOLOGY INC ADR	49,092	4.220	207,168.240	
DIDI GLOBAL INC ADR	26,813	6.490	174,016.370	
KE HOLDINGS INC ADR	23,625	22.110	522,348.750	
CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	6,336	7.230	45,809.280	
DADA NEXUS LTD ADR	4,179	16.870	70,499.730	
AGORA INC ADR	3,131	18.670	58,455.770	
LEGEND BIOTECH CORP ADR	3,309	50.540	167,236.860	

	LI AUTO INC ADR	36,908	32.460	1,198,033.680	
	XPENG INC ADR	26,054	46.830	1,220,108.820	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	34.490	156,481.130	
	HELLO GROUP INC ADR	12,641	10.130	128,053.330	
	PINDUODUO INC ADR	29,505	63.620	1,877,108.100	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	28,075	50.650	1,421,998.750	
	IQIYI INC ADR	15,440	5.110	78,898.400	
	POLYUS PJSC GDR	4,839	88.650	428,977.350	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	6,136	33.160	203,469.760	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	28,616	31.550	902,834.800	
	BEIGENE LTD ADR	3,074	298.430	917,373.820	
アメリカ・ドル	小計	2,226,986		40,928,485.260 (4,647,838,786)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	114,269	6.970	796,454.930	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	253,448	5.430	1,376,222.640	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	274,543	35.800	9,828,639.400	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	211,049	8.710	1,838,236.790	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	355,696	20.500	7,291,768.000	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	271,224	4.900	1,328,997.600	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	298,029	4.110	1,224,899.190	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	188,240	13.850	2,607,124.000	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	229,870	4.240	974,648.800	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	2,196,368		27,266,991.350 (844,458,722)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	24,584	13.275	326,352.600	
イギリス・ポンド	小計	24,584		326,352.600 (49,132,384)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	194,661	2,458.950	478,661,665.950	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,305	396.950	26,319,769.750	
	ASIAN PAINTS LTD	25,793	3,283.150	84,682,287.950	
	EICHER MOTORS LTD	10,528	2,527.650	26,611,099.200	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	15,745	1,749.200	27,541,154.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	57,514	859.700	49,444,785.800	
	SHREE CEMENT LTD	756	26,406.450	19,963,276.200	
	ICICI BANK LTD	348,649	758.000	264,275,942.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	52,605	307.350	16,168,146.750	
	STATE BANK OF INDIA LTD	118,018	494.700	58,383,504.600	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	18,888	652.150	12,317,809.200	
TATA STEEL LTD	46,472	1,180.000	54,836,960.000	
TATA MOTORS LTD	108,754	494.450	53,773,415.300	
JSW STEEL LTD	63,943	679.550	43,452,465.650	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	36,296	769.650	27,935,216.400	
TATA POWER CO LTD	87,416	228.000	19,930,848.000	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,074	3,632.450	29,328,401.300	
NESTLE INDIA LTD	2,469	19,270.250	47,578,247.250	
GAIL INDIA LTD	119,463	135.450	16,181,263.350	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	37,435	1,896.750	71,004,836.250	
VEDANTA LTD	71,958	349.700	25,163,712.600	
AXIS BANK LTD	152,895	688.050	105,199,404.750	
TITAN COMPANY LTD	22,958	2,339.350	53,706,797.300	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	149,090	147.550	21,998,229.500	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	9,999	1,438.350	14,382,061.650	
BHARAT ELECTRONICS LTD	72,574	205.550	14,917,585.700	
LUPIN LTD	17,003	883.900	15,028,951.700	
MPHASIS LTD	4,820	3,133.900	15,105,398.000	
ACC LTD	5,706	2,315.550	13,212,528.300	
BAJAJ FINANCE LTD	18,327	7,452.500	136,581,967.500	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	116,998	2,808.750	328,618,132.500	
INFOSYS LTD	232,734	1,759.250	409,437,289.500	
WIPRO LTD	91,350	638.250	58,304,137.500	
MRF LTD	160	74,221.000	11,875,360.000	
INDIAN OIL CORP LTD	101,743	120.050	12,214,247.150	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	56,024	2,332.800	130,692,787.200	
TRENT LTD	14,708	1,035.950	15,236,752.600	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,523	5,245.300	34,215,091.900	
HCL TECHNOLOGIES LTD	73,318	1,162.200	85,210,179.600	
DABUR INDIA LTD	38,036	577.800	21,977,200.800	
HERO MOTOCORP LTD	9,409	2,526.850	23,775,131.650	
SRF LTD	8,351	2,148.850	17,945,046.350	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,357	2,247.150	14,285,132.550	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,576	4,593.300	34,798,840.800	
BHARTI AIRTEL LTD	166,197	710.700	118,116,207.900	
UNITED SPIRITS LTD	22,860	925.300	21,152,358.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	54,875	761.350	41,779,081.250	
DIVI'S LABORATORIES LTD	8,869	4,506.450	39,967,705.050	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,054	7,425.650	67,231,835.100	

AUROBINDO PHARMA LTD	17,272	704.350	12,165,533.200	
HAVELLS INDIA LTD	19,190	1,392.200	26,716,318.000	
INDRAPRASTHA GAS LTD	22,037	502.400	11,071,388.800	
BIOCON LTD	20,067	372.200	7,468,937.400	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	88,501	228.800	20,249,028.800	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,071	1,504.350	21,167,708.850	
PETRONET LNG LTD	52,703	228.600	12,047,905.800	
CIPLA LTD/INDIA	30,885	893.900	27,608,101.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	45,222	1,873.400	84,718,894.800	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,618	7,440.450	49,240,898.100	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	63,456	3,636.800	230,776,780.800	
ADANI ENTERPRISES LTD	20,695	1,740.400	36,017,578.000	
NTPC LTD	307,191	126.150	38,752,144.650	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,899	2,650.100	20,933,139.900	
YES BANK LTD	714,850	14.450	10,329,582.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	39,016	377.650	14,734,392.400	
BHARAT FORGE LTD	18,024	729.950	13,156,618.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	102,860	455.100	46,811,586.000	
ITC LTD	219,139	236.100	51,738,717.900	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,382	2,325.750	26,471,686.500	
UNITED PHOSPHORUS LTD	38,261	737.450	28,215,574.450	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,929	3,086.650	12,127,447.850	
SIEMENS INDIA LTD	5,950	2,445.350	14,549,832.500	
INFO EDGE INDIA LTD	5,769	5,646.000	32,571,774.000	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	22,126	943.000	20,864,818.000	
TECH MAHINDRA LTD	41,688	1,602.650	66,811,273.200	
MINDTREE LTD	3,887	4,576.550	17,789,049.850	
MARICO LTD	32,108	526.350	16,900,045.800	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	39,992.000	15,116,976.000	
DLF LTD	48,259	419.100	20,225,346.900	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	205,284	202.650	41,600,802.600	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	38,587	767.700	29,623,239.900	
BAJAJ FINSERV LTD	2,848	17,711.100	50,441,212.800	
BAJAJ AUTO LTD	4,914	3,344.750	16,436,101.500	
JUBILANT FOODWORKS LTD	4,677	3,788.050	17,716,709.850	
MUTHOOT FINANCE LTD	8,810	1,491.950	13,144,079.500	
COAL INDIA LTD	88,391	151.300	13,373,558.300	
INDUS TOWERS LTD	54,946	273.350	15,019,489.100	
PI INDUSTRIES LTD	6,020	2,915.400	17,550,708.000	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	3,823	6,613.200	25,282,263.600	
ADANI GREEN ENERGY LTD	29,705	1,388.900	41,257,274.500	

	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	67,614	684.750	46,298,686.500	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,012	2,549.750	10,229,597.000	
	BANDHAN BANK LTD	37,750	280.050	10,571,887.500	
	ADANI TOTAL GAS LTD	20,723	1,825.000	37,819,475.000	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,916	2,099.200	20,815,667.200	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	23,985	579.800	13,906,503.000	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	16,624	921.950	15,326,496.800	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	20,386	857.950	17,490,168.700	
	ZOMATO LTD	125,644	140.550	17,659,264.200	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	18,598	762.500	14,180,975.000	
	ADANI TRANSMISSIONS LTD	20,756	1,874.200	38,900,895.200	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	10,551	4,796.600	50,608,926.600	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	13,209	1,439.900	19,019,639.100	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	27,604	578.150	15,959,252.600	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	7,733	1,997.600	15,447,440.800	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	28,244	1,175.600	33,203,646.400	
インド・ルピー	小計	5,895,043		4,996,753,291.800 (7,545,097,471)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,320.000	1,326,344,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,540,500	880.000	2,235,640,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	133,301	23,000.000	3,065,923,000.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,625.000	2,337,962,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	451,000	4,430.000	1,997,930,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,290,900	5,925.000	7,648,582,500.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,297,400	4,150.000	13,684,210,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	579,100	6,050.000	3,503,555,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	32,050.000	1,038,420,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	53,600	12,000.000	643,200,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	8,000.000	1,526,400,000.000	
	BANK MANDIRI	1,219,300	7,200.000	8,778,960,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,594,000	4,130.000	18,973,220,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	572,200	6,775.000	3,876,655,000.000	

	KALBE FARMA TBK PT	1,156,000	1,610.000	1,861,160,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	269,200	7,875.000	2,119,950,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	3,776,600	7,375.000	27,852,425,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,920.000	1,793,472,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,850.000	1,460,250,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	3,200.000	1,706,560,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,718,300	1,145.000	1,967,453,500.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	825,100	3,700.000	3,052,870,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	25,256,701		112,451,142,500.000 (888,364,026)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	8,832	137.220	1,211,927.040	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	15.050	89,397.000	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	700	115.420	80,794.000	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	39.140	117,420.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	13.400	160,800.000	
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	5,200	160.970	837,044.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	7,540	25.550	192,647.000	
	WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	12.220	199,186.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.550	220,605.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	25.000	100,000.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	142.500	171,000.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	3,900	47.790	186,381.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	7,500	28.510	213,825.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	298.600	627,060.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,330	23.890	246,783.700	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	46.110	244,383.000	

SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	16.200	95,580.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	26.140	499,274.000	
GEM CO LTD	29,100	11.080	322,428.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	149.700	389,220.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	61.500	424,350.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	7.740	143,964.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	6,500	149.990	974,935.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	8,568	25.650	219,769.200	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	35.080	207,112.320	
ZHEJIANG NHU CO LTD	6,960	28.280	196,828.800	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	16.500	43,890.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	22.600	149,160.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	39.380	133,892.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	30.400	155,040.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	15.240	22,860.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	14.350	37,310.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	69.750	320,850.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	3,000	60.110	180,330.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	16.820	185,020.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	27,100	50.950	1,380,745.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	7,200	127.270	916,344.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	17.060	307,080.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	15.820	161,364.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	14.050	157,360.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	8.710	273,494.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	14.950	83,720.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	4.660	66,638.000	

WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	14.360	39,202.800	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	18.850	49,010.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	28.880	225,264.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	50,250	17.170	862,792.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	25.630	153,780.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	220.440	705,408.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	34.590	123,486.300	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	11.220	142,494.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	9.050	77,830.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	7.410	271,947.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	23,381	44.350	1,036,947.350	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	46.580	503,064.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	560	68.560	38,393.600	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	22.000	151,800.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	6.090	232,638.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	45.190	221,431.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	10.540	161,262.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	7.620	160,020.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	35.960	269,700.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	39.630	198,150.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	118,600	3.640	431,704.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	25.090	165,594.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,100	252.170	1,790,407.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	70.850	786,435.000	

BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	9.800	146,510.000	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	9.100	161,070.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	15,300	41.690	637,857.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	13.870	82,387.800	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,320	28.360	150,875.200	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	4.380	70,080.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	128.050	268,905.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	8.360	304,972.800	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	10.880	155,584.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	30,654	45.320	1,389,239.280	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	6.500	178,750.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	33,100	7.900	261,490.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	14.700	292,530.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	23,900	25.620	612,318.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	7.420	28,196.000	
IFLYTEK CO LTD	13,500	53.800	726,300.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.380	249,186.000	
GOERTEK INC	20,200	54.300	1,096,860.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.640	162,732.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	33,000	39.700	1,310,100.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	13,300	22.690	301,777.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	6.500	308,100.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.470	211,401.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	6.420	241,392.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	41,660	18.050	751,963.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	8.170	185,459.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	3,200	31.330	100,256.000	

YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,800	92.970	353,286.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	45,508	36.900	1,679,245.200	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,600	185.060	1,406,456.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	15,300	247.000	3,779,100.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	6.470	134,576.000	
SUNING.COM CO LTD	23,700	4.060	96,222.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	213,400	5.160	1,101,144.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	63,500	12.620	801,370.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	66,800	11.280	753,504.000	
PING AN BANK CO LTD	83,400	18.380	1,532,892.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	8,780	17.270	151,630.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	71,200	5.320	378,784.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,300	20.160	832,608.000	
ZTE CORP	24,300	32.110	780,273.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.390	210,615.000	
WEICHAO POWER CO LTD	21,200	17.500	371,000.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	37.370	156,954.000	
GF SECURITIES CO LTD	21,800	24.670	537,806.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	17.770	374,947.000	
BYD CO LTD	7,300	301.420	2,200,366.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	7.610	259,501.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	4,830	129.600	625,968.000	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	2,900	122.670	355,743.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	29.490	324,390.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	24.270	434,433.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	12,900	37.020	477,558.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	57.820	167,678.000	

APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	36.720	293,760.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,700	367.920	993,384.000	
JIANGXI ZHENGBO TECHNOLOGY CO LTD	3,600	9.680	34,848.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	10.930	373,806.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	21.050	116,827.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	3,000	265.920	797,760.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	10.470	163,332.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	75.290	496,914.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	65.750	39,450.000	
NINESTAR CORP	5,700	46.740	266,418.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	20.930	146,928.600	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	4.050	136,890.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	10.320	123,840.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	6,720	80.990	544,252.800	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	82.110	131,376.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,500	470.000	705,000.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	2,300	244.720	562,856.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	7.700	116,270.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	19.240	101,972.000	
SF HOLDING CO LTD	23,800	65.510	1,559,138.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	180.000	324,000.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	7.180	169,448.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	140.700	351,750.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	7.210	459,925.900	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	12.210	474,969.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	176.350	405,605.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	30.500	414,800.000	

SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,940	184.500	542,430.000	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	12,600	41.170	518,742.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	33,500	21.400	716,900.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	141.800	439,580.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	12.800	288,000.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,560	38.250	59,670.000	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	11,500	15.150	174,225.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	36.290	188,708.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	10,200	40.190	409,938.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	84.540	266,301.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	2,800	265.000	742,000.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	78.990	213,273.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	67.970	210,707.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	140.010	294,021.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	128.250	554,040.000	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	14.620	138,890.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	38.700	116,100.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	17.120	133,536.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	107.070	89,938.800	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	700	134.360	94,052.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	59.280	160,056.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	51.710	68,774.300	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	92.210	119,873.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	85.850	257,550.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	2,000	112.690	225,380.000	

CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	11.110	141,097.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	3,800	145.860	554,268.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	11.650	314,550.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	107.000	203,300.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	10.090	98,882.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	11.890	171,216.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,500	370.590	1,667,655.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	9.590	148,645.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	207.000	248,400.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	62.620	254,237.200	
SG MICRO CORP	900	315.340	283,806.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	9,100	639.950	5,823,545.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,416	174.880	597,390.080	
WUXI APPTec CO LTD	10,872	139.900	1,520,992.800	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,400	50.210	522,184.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	3,900	134.780	525,642.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	1,600	363.090	580,944.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	36,300	16.480	598,224.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	3,300	177.120	584,496.000	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,800	150.000	570,000.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	6,400	75.000	480,000.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	99,079	5.000	495,395.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	305.980	1,162,724.000	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	1,700	201.450	342,465.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	17,100	28.110	480,681.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	129,100	3.500	451,850.000	

PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	3.760	307,192.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	41.020	438,914.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	208.390	187,551.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	173,700	4.750	825,075.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,000	418.970	418,970.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	600	711.630	426,978.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	5.290	569,733.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	9,000	63.630	572,670.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	64.260	391,986.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	8,500	58.720	499,120.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	1,200	59.830	71,796.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	3,900	138.410	539,799.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	6,200	92.110	571,082.000	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	50,600	10.830	547,998.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	1,900	247.400	470,060.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	193.000	115,800.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	10,900	51.770	564,293.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,000	607.500	607,500.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	4,300	159.080	684,044.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	264.730	647,794.310	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	16,400	27.940	458,216.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	455	816.980	371,725.900	
PETROCHINA CO LTD	110,900	4.970	551,173.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	4.660	986,988.000	

AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	2.940	806,736.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.070	257,880.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	158,500	4.220	668,870.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	30.400	304,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	13,400	21.700	290,780.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	81,500	53.490	4,359,435.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	41,500	51.220	2,125,630.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	100,100	19.420	1,943,942.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	102,000	8.770	894,540.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	3.940	544,508.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	24,900	21.830	543,567.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	5,100	2,090.000	10,659,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.610	583,165.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	56,500	26.440	1,493,860.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	30,700	28.140	863,898.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.700	218,310.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	100,200	19.530	1,956,906.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	238,100	3.390	807,159.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	230,500	4.860	1,120,230.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	27,100	12.200	330,620.000	
HUAXIA BANK CO LTD	82,900	5.670	470,043.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	30,400	42.290	1,285,616.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.440	390,276.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	30,800	3.950	121,660.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	126,400	7.010	886,064.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,000	39.440	552,160.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	17.950	601,325.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	8.130	63,414.000	

GREAT WALL MOTOR CO LTD	14,100	56.750	800,175.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	14.970	675,147.000	
CRRG CORP LTD	77,000	6.160	474,320.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	22,452	51.260	1,150,889.520	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	18,900	52.250	987,525.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	28,300	16.960	479,968.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	14,100	5.620	79,242.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,900	39.380	586,762.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,800	30.500	847,900.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	47,200	23.170	1,093,624.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	10,300	5.880	60,564.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	51.950	410,405.000	
GEMDALE CORP	10,600	11.220	118,932.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	13,500	102.600	1,385,100.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	92,700	10.260	951,102.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	68,500	7.940	543,890.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	10.620	335,592.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	30,120	40.660	1,224,679.200	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.380	130,524.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,200	229.680	2,113,056.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	235,900	2.960	698,264.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	200	105.940	21,188.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.910	97,750.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	115,700	6.390	739,323.000	
AIR CHINA LTD	28,400	8.550	242,820.000	
TBEA CO LTD	26,700	22.350	596,745.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	45,700	4.060	185,542.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	84,300	7.440	627,192.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	13,700	24.650	337,705.000	

SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	46.470	153,351.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	29.940	206,586.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	17,200	23.310	400,932.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	5.110	175,273.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	28.110	233,313.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	11.210	165,908.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	12.810	61,488.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	11.950	283,215.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	14,400	61.990	892,656.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	9.300	270,630.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	13.790	104,804.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	59,970	19.390	1,162,818.300	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	57,800	5.910	341,598.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	10.010	282,282.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	19.210	182,879.200	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	52.490	398,924.000	
BBMG CORP	54,200	2.760	149,592.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	3.960	116,424.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	18,600	22.760	423,336.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	4.830	186,438.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	20.330	305,336.270	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	11.220	86,394.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	7,896	62.040	489,867.840	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	35.850	582,562.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	21,600	24.490	528,984.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.500	212,550.000	

SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	3.310	195,290.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,900	46.200	503,580.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.050	171,045.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.630	169,728.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	71.110	327,106.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	8.900	149,520.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	5.530	217,882.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	11.950	234,220.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,100	455.000	1,410,500.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	5,180	334.110	1,730,689.800	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	17.710	21,252.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	10.120	253,000.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	12.600	284,760.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	4.920	128,904.000	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	28.960	156,384.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	17.060	214,956.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	5.870	176,100.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	40.150	168,630.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE CO LTD	5,600	12.100	67,760.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	20.640	120,331.200	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.130	143,134.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	23.160	104,220.000	
TONGWEI CO LTD	21,000	48.430	1,017,030.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	7,830	64.380	504,095.400	
JCET GROUP CO LTD	10,900	32.130	350,217.000	

HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	63.000	428,400.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	162.880	407,200.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	55.620	294,786.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	18.900	105,840.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	12,090	30.460	368,261.400	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	100	220.430	22,043.000	
CHINA JUSHI CO LTD	26,746	17.400	465,380.400	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	7,324	85.200	624,004.800	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	18.600	364,560.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	21.500	337,550.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	131.660	223,822.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	59.060	289,394.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	24,420	86.810	2,119,900.200	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	219.190	394,542.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	12.650	409,240.150	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	16,824	115.000	1,934,760.000	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	58.200	291,000.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	22.480	26,976.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	74.670	433,086.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	12.130	160,116.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	9,600	51.900	498,240.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	21,400	17.460	373,644.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	6.900	411,930.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	79.590	270,606.000	
SKSHU PAINT CO LTD	3,800	135.000	513,000.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	91,100	6.030	549,333.000	

	BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	14.150	333,940.000	
	SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	40.360	460,104.000	
	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,430	55.310	79,093.300	
	SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	18.720	37,440.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	32,100	17.870	573,627.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	108.020	129,624.000	
	JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	73.860	110,790.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	10.910	427,672.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	7,416	8.370	62,071.920	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	212.200	169,760.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,700	136.300	640,610.000	
	TOLY BREAD CO LTD	5,040	32.040	161,481.600	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	50.800	145,288.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	81.320	239,080.800	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	15.660	303,804.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.250	244,000.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,000	62.770	376,620.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	30,660	4.240	129,998.400	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	30.900	330,630.000	
	オフショア・人民元 小計	9,155,164		188,019,411.880 (3,350,280,296)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	350,093	20.000	7,001,860.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	168,576	6.667	1,123,896.190	
	OOREDOO QSC	43,816	6.866	300,840.650	
	QATAR FUEL QSC	44,848	17.770	796,948.960	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	39,892	16.850	672,180.200	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	9.409	480,122.450	
	INDUSTRIES QATAR QSC	116,259	15.150	1,761,323.850	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	95,644	18.000	1,721,592.000	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	145,382	3.307	480,778.270	

	MASRAF AL RAYAN	314,536	4.814	1,514,176.300	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.170	438,883.330	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	378,694	2.156	816,464.260	
カタール・リアル 小計		1,887,217		17,109,066.460 (530,552,151)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	310,076	0.834	258,603.380	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	162,480	0.596	96,838.080	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	464,096	0.986	457,598.650	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	89,203	0.944	84,207.630	
	MABANEE CO KPSC	55,241	0.814	44,966.170	
	BOUBYAN BANK KSCP	51,966	0.795	41,312.970	
クウェート・ディナール 小計		1,133,062		983,526.880 (369,589,731)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	39,289	21,620.000	849,428,180.000	
	ECOPETROL SA	281,230	2,707.000	761,289,610.000	
	BANCOLOMBIA SA	11,682	32,220.000	376,394,040.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,129	32,200.000	1,131,153,800.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	26,255	25,150.000	660,313,250.000	
コロンビア・ペソ 小計		393,585		3,778,578,880.000 (110,202,253)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	14,790	64.700	956,913.000	
	JARIR MARKETING CO	3,378	191.000	645,198.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	75.400	313,287.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	28,728	30.600	879,076.800	
	SAUDI BRITISH BANK	52,496	29.350	1,540,757.600	
	AL RAJHI BANK	83,526	134.800	11,259,304.800	
	ARAB NATIONAL BANK	47,191	22.060	1,041,033.460	
	BANK ALBILAD	26,757	42.100	1,126,469.700	
	BANK AL-JAZIRA	16,517	19.380	320,099.460	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,640	41.000	1,543,240.000	
	RIYAD BANK	87,636	26.750	2,344,263.000	
	SAUDI TELECOM CO	41,175	107.000	4,405,725.000	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	13,488	169.800	2,290,262.400	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	61,151	109.600	6,702,149.600	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	56.300	364,655.100	
	SAUDI ELECTRICITY CO	53,009	23.860	1,264,794.740	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	19,455	30.950	602,132.250	
SAVOLA GROUP	22,457	33.150	744,449.550		

	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	20.520	462,274.560	
	ALMARAI CO JSC	14,454	48.700	703,909.800	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	11.320	320,480.520	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	18,456	41.950	774,229.200	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	8,395	68.000	570,860.000	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,445	17.280	1,044,489.600	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	9.920	307,629.120	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	22,738	21.960	499,326.480	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	43,314	12.400	537,093.600	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,986	134.200	400,721.200	
	ALINMA BANK	75,115	23.000	1,727,645.000	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	3,516	110.200	387,463.200	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	28,780	72.300	2,080,794.000	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	8,516	38.900	331,272.400	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,377	164.600	555,854.200	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	154,032	34.800	5,360,313.600	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	4,212	162.400	684,028.800	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	149,680	62.200	9,310,096.000	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,299,892		64,402,292.740 (1,952,677,516)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	103,700	33.500	3,473,950.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	331,200	12.400	4,106,880.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	84,000	44.000	3,696,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	67,800	125.000	8,475,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,108,355	4.600	5,098,433.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	4,400	171.500	754,600.000	
	SHIN CORP PCL	91,200	75.250	6,862,800.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	23.700	7,110,000.000	

ADVANCED INFO SERVICE PCL	75,200	216.000	16,243,200.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	290,620	14.400	4,184,928.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	21,000	428.000	8,988,000.000	
PTT PCL	649,700	37.500	24,363,750.000	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	140,700	20.100	2,828,070.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	67,700	56.500	3,825,050.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	363,900	8.650	3,147,735.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	58,150	375.000	21,806,250.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	269,700	61.750	16,653,975.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	145,500	55.000	8,002,500.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	634,400	22.700	14,400,880.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,800	143.000	5,691,400.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	248,010	29.000	7,192,290.000	
THAI OIL PCL NVDR	83,100	48.250	4,009,575.000	
CP ALL PCL NVDR	382,400	58.500	22,370,400.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	242,000	9.350	2,262,700.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	94,645	118.500	11,215,432.500	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	131,322	40.000	5,252,880.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	128,108	58.250	7,462,291.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	119,500	82.500	9,858,750.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	647,800	8.600	5,571,080.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	39.250	2,221,550.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	196,900	40.750	8,023,675.000	
OSOTSPA PCL NVDR	24,300	33.250	807,975.000	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	20.600	2,169,180.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	353,600	4.380	1,548,768.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	86,133	34.250	2,950,055.250	
SCG PACKAGING PCL NVDR	90,400	63.000	5,695,200.000	
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	71,200	61.250	4,361,000.000	

	SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	128,200	28.750	3,685,750.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	25.500	5,013,300.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	26,200	116.000	3,039,200.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	58.250	3,559,075.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	74.500	3,657,950.000	
タイ・パーツ 小計		8,369,543		291,641,477.750 (988,664,610)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	3,899	895.500	3,491,554.500	
	CEZ	9,586	802.500	7,692,765.000	
	MONETA MONEY BANK AS	26,989	95.000	2,563,955.000	
チェコ・コルナ 小計		40,474		13,748,274.500 (69,636,385)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,300,437	37.960	201,204,588.520	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	5,420	27,300.000	147,966,000.000	
	BANCO DE CHILE	3,758,188	76.500	287,501,382.000	
	EMPRESAS CMPC SA	107,743	1,383.600	149,073,214.800	
	EMPRESAS COPEC SA	20,844	6,300.000	131,317,200.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,581	6,851.000	72,490,431.000	
	ENEL AMERICAS SA	1,596,888	102.650	163,920,553.200	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,972	48,801.000	486,643,572.000	
	FALABELLA SA	48,873	2,664.000	130,197,672.000	
	CENCOSUD SA	81,121	1,330.000	107,890,930.000	
	ENEL CHILE SA	1,494,473	33.660	50,303,961.180	
チリ・ペソ 小計		12,434,540		1,928,509,504.700 (259,974,652)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	238,837	7.270	1,736,344.990	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	24.500	1,100,001.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	96,186	26.720	2,570,089.920	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	258.500	1,206,678.000	
	KOC HOLDING AS	53,770	33.180	1,784,088.600	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	15.790	1,421,100.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	99,281	20.000	1,985,620.000	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	181,455	11.730	2,128,467.150	
	TURKIYE IS BANKASI	91,135	7.620	694,448.700	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	11,253	173.000	1,946,769.000	

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	37,907	77.050	2,920,734.350	
トルコ・リラ 小計		949,390		19,494,341.710 (159,843,855)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	11,424	8,510.000	97,218,240.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	28,377	2,446.000	69,410,142.000	
	OTP BANK NYRT	14,487	17,445.000	252,725,715.000	
ハンガリー・フォロント 小計		54,288		419,354,097.000 (147,275,901)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	479,000	35.550	17,028,450.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	171,630	57.900	9,937,377.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	95,400	90.650	8,648,010.000	
	AYALA CORP	21,553	869.000	18,729,557.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,570	3,366.000	8,650,620.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	73,840	197.400	14,576,016.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	199,650	56.450	11,270,242.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	33,940	233.200	7,914,808.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	153,275	51.500	7,893,662.500	
	BDO UNIBANK INC	110,323	123.500	13,624,890.500	
	PLDT INC	5,260	1,730.000	9,099,800.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	694,275	35.150	24,403,766.250	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	43,330	129.500	5,611,235.000	
	SM INVESTMENTS CORP	18,603	940.000	17,486,820.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	3.880	3,499,372.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	296.800	5,256,328.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	570.000	3,762,570.000	
	AC ENERGY CORP	689,400	10.740	7,404,156.000	
MONDE NISSIN CORP	314,700	16.000	5,035,200.000		
フィリピン・ペソ 小計		4,032,960		199,832,880.750 (450,563,196)	
ブラジル・レアル	BRF SA	47,292	20.120	951,515.040	
	VALE SA	269,121	75.650	20,359,003.650	
	RAIA DROGASIL SA	63,900	24.010	1,534,239.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,750	34.720	720,440.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	35.400	697,380.000	
	BANCO DO BRASIL SA	63,900	32.500	2,076,750.000	
	ITAUSA SA	332,560	9.700	3,225,832.000	
	GERDAU SA	87,830	29.590	2,598,889.700	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	243,910	31.490	7,680,725.900	

VIBRA ENERGIA SA	66,200	22.850	1,512,670.000	
PETROLEO BRASILEIRO SA	329,212	29.650	9,761,135.800	
CCR SA	90,920	12.500	1,136,500.000	
WEG SA	103,644	35.800	3,710,455.200	
BANCO BRADESCO SA PREF	336,393	20.210	6,798,502.530	
BANCO BRADESCO SA	85,357	17.200	1,468,140.400	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	34,306	24.380	836,380.280	
BRADESPAR SA	17,958	53.530	961,291.740	
SUZANO SA	49,275	58.500	2,882,587.500	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	327,347	22.160	7,254,009.520	
AMERICANAS SA	40,871	28.500	1,164,823.500	
BRASKEM SA	12,300	54.200	666,660.000	
ENGIE BRASIL SA	16,587	39.240	650,873.880	
ALPARGATAS SA	19,400	40.620	788,028.000	
LOCALIZA RENT A CAR	37,289	56.700	2,114,286.300	
LOJAS RENNER SA	57,920	28.400	1,644,928.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	55,904	15.280	854,213.120	
COSAN SA	73,300	22.260	1,631,658.000	
TOTVS SA	21,200	32.330	685,396.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	50,200	23.910	1,200,282.000	
JBS SA	66,500	35.190	2,340,135.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	86,917	13.970	1,214,230.490	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,098	38.630	1,046,795.740	
HYPERA SA	33,500	29.530	989,255.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	400,048	12.380	4,952,594.240	
MAGAZINE LUIZA SA	226,400	6.370	1,442,168.000	
TELEFONICA BRASIL SA	31,428	49.100	1,543,114.800	
VIA S/A	99,200	5.480	543,616.000	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	38,800	21.150	820,620.000	
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	32,500	63.750	2,071,875.000	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	79,800	11.200	893,760.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	15.550	464,945.000	
AMBEV SA	314,695	15.950	5,019,385.250	
NATURA &CO HOLDING SA	69,000	26.150	1,804,350.000	
TIM SA	72,100	13.240	954,604.000	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	30,900	50.220	1,551,798.000	
RUMO SA	104,900	18.020	1,890,298.000	

ブラジル・リアル 小計		4,718,232		117,111,141.580 (2,370,528,595)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,410	450.000	634,500.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,155	142.250	1,586,798.750	
	BANK PEKAO SA	10,428	115.000	1,199,220.000	
	ORANGE POLSKA SA	20,700	7.800	161,460.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	16,793	73.500	1,234,285.500	
	LPP SA	86	17,300.000	1,487,800.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,881	336.800	970,320.800	
	CD PROJEKT RED SA	4,633	178.540	827,175.820	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	54,022	43.500	2,349,957.000	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	129,398	5.720	740,156.560	
	CYFROWY POLSAT SA	20,000	34.540	690,800.000	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	8.100	422,755.200	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	45,967	36.790	1,691,125.930	
	DINO POLSKA SA	3,464	335.000	1,160,440.000	
	ALLEGRO.EU SA	27,648	38.000	1,050,624.000	
ポーランド・ズロチ 小計		400,777		16,207,419.560 (450,541,953)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	179,000	3.190	571,010.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	414,300	5.180	2,146,074.000	
	DIGI.COM BHD	235,300	4.040	950,612.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	89,720	5.650	506,918.000	
	RHB BANK BHD	140,880	5.350	753,708.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	7.500	237,750.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	382,300	2.160	825,768.000	
	GENTING BHD	171,300	4.500	770,850.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	17.060	345,567.360	
	HONG LEONG BANK BHD	50,608	17.980	909,931.840	
	IOI CORP BHD	190,813	3.720	709,824.360	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	19,800	20.800	411,840.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	24.100	279,560.000	
	MALAYAN BANKING BHD	320,175	8.120	2,599,821.000	
	MISC BHD	100,880	6.560	661,772.800	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	131.200	537,920.000	
PPB GROUP BHD	46,260	16.960	784,569.600		

	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	19.540	435,742.000	
	PETRONAS GAS BHD	55,400	16.460	911,884.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	219,800	2.810	617,638.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	5.210	309,995.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	178,050	9.160	1,630,938.000	
	QL RESOURCES BHD	25,250	4.670	117,917.500	
	DIALOG GROUP BHD	200,944	2.450	492,312.800	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	989,550	3.990	3,948,304.500	
	SIME DARBY BERHAD	139,500	2.150	299,925.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	105,800	5.200	550,160.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	170,100	3.780	642,978.000	
	MAXIS BHD	185,300	4.410	817,173.000	
	INARI AMERTRON BHD	255,500	3.970	1,014,335.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	178,500	8.420	1,502,970.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	106,000	6.580	697,480.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	22,600	4.040	91,304.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	209,500	5.470	1,145,965.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	159,200	3.750	597,000.000	
	マレーシア・リンギット 小計	5,691,786		29,827,518.760 (804,024,630)	
メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	222,300	15.610	3,470,103.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	117,600	58.400	6,867,840.000	
	GRUMA SAB DE CV	18,045	261.240	4,714,075.800	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,860	154.170	2,753,476.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	59.940	2,091,906.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	169,600	132.490	22,470,304.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	78,425	53.290	4,179,268.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,110	240.810	3,157,019.100	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	136,200	30.670	4,177,254.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	16,230	414.610	6,729,120.300	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	210,652	92.000	19,379,984.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,297,878	20.080	46,141,390.240	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	172,000	21.720	3,735,840.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	20,600	131.050	2,699,630.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	347,100	73.700	25,581,270.000	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	23,325	263.110	6,137,040.750	
	TELESITES SAB DE CV	77,300	18.890	1,460,197.000	
	BECLE SAB DE CV	38,400	50.560	1,941,504.000	
メキシコ・ペソ	小計	4,011,525		167,687,222.640 (912,168,185)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	193,358	1.090	210,760.220	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	11,007	16.080	176,992.560	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	181,940	0.912	165,929.280	
	OPAP SA	15,554	12.570	195,513.780	
	JUMBO SA	9,601	12.900	123,852.900	
	PUBLIC POWER CORP	16,000	9.750	156,000.000	
ユーロ	小計	430,590		1,029,048.740 (132,140,149)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,472	181,500.000	267,168,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,014	23,000.000	115,322,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,226	100,000.000	222,600,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,371	211,000.000	500,281,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,450	57,000.000	196,650,000.000	
	COWAY CO LTD	3,495	76,500.000	267,367,500.000	
	KT&G CORP	8,833	86,000.000	759,638,000.000	
	S-1 CORPORATION	187	75,500.000	14,118,500.000	
	CJ CORP	1,001	85,600.000	85,685,600.000	
	KAKAO CORP	21,011	122,500.000	2,573,847,500.000	
	CJ ENM CO LTD	761	142,500.000	108,442,500.000	
	SK TELECOM CO LTD	2,204	55,800.000	122,983,200.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	20,059	9,130.000	183,138,670.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,085	727,000.000	788,795,000.000	
	LG UPLUS CORP	14,606	13,900.000	203,023,400.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	22,317	22,000.000	490,974,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	632	1,165,000.000	736,280,000.000	
	LG CHEM LTD	3,122	740,000.000	2,310,280,000.000	
	LG CHEM LTD	499	339,500.000	169,410,500.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	102	613,000.000	62,526,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	29,007	37,300.000	1,081,961,100.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	17,291	27,350.000	472,908,850.000	
	S-OIL CORP	2,413	88,000.000	212,344,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	7,798	37,100.000	289,305,800.000	

MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	5,150.000	104,297,800.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,618	49,300.000	227,667,400.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	1,953	145,000.000	283,185,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,022	231,500.000	236,593,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,900	77,200.000	223,880,000.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,043	98,900.000	202,052,700.000	
HYUNDAI MOBIS	4,366	244,500.000	1,067,487,000.000	
SK HYNIX INC	37,069	120,500.000	4,466,814,500.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,583	49,950.000	328,820,850.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	96,600.000	146,349,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	9,542	207,500.000	1,979,965,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,059	42,300.000	256,295,700.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,371	10,950.000	201,162,450.000	
KIA CORPORATION	17,718	85,400.000	1,513,117,200.000	
KOREA ZINC CO LTD	614	513,000.000	314,982,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	20,723	22,150.000	459,014,450.000	
KOREAN AIR CO LTD	13,829	29,400.000	406,572,600.000	
CJ LOGISTICS	355	135,000.000	47,925,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,199	180,000.000	215,820,000.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	2,123	78,100.000	165,806,300.000	
HLB INC	6,789	36,600.000	248,477,400.000	
LG ELECTRONICS INC	7,162	126,000.000	902,412,000.000	
LG CORP	5,592	86,600.000	484,267,200.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	13,350.000	122,326,050.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,631	41,000.000	189,871,000.000	
NAVER CORP	8,364	395,000.000	3,303,780,000.000	
L&F CO LTD	1,848	205,900.000	380,503,200.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,932	82,600.000	242,183,200.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,347	45,850.000	107,609,950.000	
KANGWON LAND INC	8,499	24,250.000	206,100,750.000	
POSCO	4,941	281,500.000	1,390,891,500.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12,815	22,900.000	293,463,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,716	709,000.000	2,634,644,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,581	178,000.000	637,418,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	237,000.000	97,170,000.000	

SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	326,897	76,900.000	25,138,379,300.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	52,468	5,760.000	302,215,680.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	56,124	70,600.000	3,962,354,400.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,563	33,800.000	52,829,400.000	
YUHAN CORP	2,462	63,400.000	156,090,800.000	
HANON SYSTEMS	16,143	13,800.000	222,773,400.000	
GS HOLDINGS CORP	2,879	40,250.000	115,879,750.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,095	22,350.000	315,023,250.000	
CELLTRION INC	6,485	208,000.000	1,348,880,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	19,354	43,100.000	834,157,400.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,065	158,500.000	168,802,500.000	
CELLTRION PHARM INC	988	124,900.000	123,401,200.000	
LOTTE SHOPPING CO	538	90,400.000	48,635,200.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,458	67,300.000	367,323,400.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,347	179,000.000	420,113,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,361	217,500.000	731,017,500.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	707	376,000.000	265,832,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	20,172	5,630.000	113,568,360.000	
LG INNOTEK CO LTD	855	305,000.000	260,775,000.000	
SK INC	2,767	265,000.000	733,255,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	26,337	57,900.000	1,524,912,300.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,999	29,450.000	176,670,550.000	
ILJIN MATERIALS CO LTD	1,949	121,500.000	236,803,500.000	
HANMI PHARM CO LTD	548	280,500.000	153,714,000.000	
SEEGENE INC	1,958	64,500.000	126,291,000.000	
E-MART CO LTD	1,426	152,000.000	216,752,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,261	41,100.000	216,227,100.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	3,784	57,300.000	216,823,200.000	
BGF RETAIL CO LTD	216	151,000.000	32,616,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,760	102,000.000	179,520,000.000	
SK CHEMICALS CO LTD	613	148,000.000	90,724,000.000	
NETMARBLE CORP	1,478	121,000.000	178,838,000.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	30,772	13,000.000	400,036,000.000	
ECOPRO BM CO LTD	873	519,300.000	453,348,900.000	
SD BIOSENSOR INC	3,095	53,000.000	164,035,000.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,002	106,500.000	213,213,000.000	
KRAFTON INC	1,459	489,500.000	714,180,500.000	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,190	176,000.000	209,440,000.000	

	SK SQUARE CO LTD	1,425	63,300.000	90,202,500.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	1,672	249,000.000	416,328,000.000	
	KAKAO GAMES CORP	2,515	91,000.000	228,865,000.000	
	HYBE CO LTD	1,167	352,000.000	410,784,000.000	
	KAKAObANK CORP	6,133	63,400.000	388,832,200.000	
	F&F CO LTD / NEW	274	869,000.000	238,106,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,872	161,500.000	463,828,000.000	
	ALTEOGEN INC	2,026	87,100.000	176,464,600.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,349	119,500.000	639,205,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,127	901,000.000	1,015,427,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,080	124,800.000	259,584,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,418	41,600.000	100,588,800.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,590	82,500.000	461,175,000.000	
韓国・ウォン 小計		1,088,696		82,398,819,010.000 (7,943,246,153)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	13.040	873,680.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	7.920	712,800.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	180,000	4.610	829,800.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	116.440	745,216.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	98,500	38.400	3,782,400.000	
	BEIJING ENTERPRISES	45,000	25.600	1,152,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	342,000	4.380	1,497,960.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	242,000	7.320	1,771,440.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	108,000	13.580	1,466,640.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	51,590	16.760	864,648.400	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	35,500	39.350	1,396,925.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	3.650	518,300.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	585,600	8.600	5,036,160.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	291,120	19.520	5,682,662.400	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	216,888	34.750	7,536,858.000	
	CITIC LTD	440,000	7.620	3,352,800.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	44,000	4.780	210,320.000	
	LENOVO GROUP LTD	470,000	8.520	4,004,400.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,356,000	3.530	4,786,680.000	

CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	110,590	10.980	1,214,278.200	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,595,200	3.680	5,870,336.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	85,000	13.460	1,144,100.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	163,000	23.150	3,773,450.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	52,600	137.700	7,243,020.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	276,000	7.520	2,075,520.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	164,000	6.690	1,097,160.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	35,200	7.100	249,920.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	120,000	14.100	1,692,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	244,000	4.290	1,046,760.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	85,000	25.650	2,180,250.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	96,500	8.180	789,370.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	193,200	14.820	2,863,224.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	44,500	38.500	1,713,250.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	394,000	24.200	9,534,800.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	58,000	41.550	2,409,900.000	
BYD CO LTD	53,500	289.800	15,504,300.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	6.510	768,180.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,030,000	0.790	813,700.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	281,592	5.540	1,560,019.680	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	208,000	12.180	2,533,440.000	
MMG LTD	184,000	2.720	500,480.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	5.600	392,000.000	
CHINA YOUZAN LTD	1,000,000	0.720	720,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	521,788	6.850	3,574,247.800	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	5.390	727,650.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	149,200	24.250	3,618,100.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	200,000	30.100	6,020,000.000	

CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	509,000	13.320	6,779,880.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	433,000	10.100	4,373,300.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	204,000	11.000	2,244,000.000	
WEICHAI POWER CO LTD	127,440	15.500	1,975,320.000	
TINGYI HOLDING CORP	140,000	15.220	2,130,800.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	38,000	69.700	2,648,600.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	174,000	10.040	1,746,960.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	238,000	3.690	878,220.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	95,333	66.150	6,306,277.950	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	40,000	6.940	277,600.000	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	71,000	18.080	1,283,680.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	670,250	5.650	3,786,912.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	209,000	45.650	9,540,850.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	393,500	463.400	182,347,900.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	433,500	57.800	25,056,300.000	
LI NING CO LTD	150,000	93.750	14,062,500.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	128,000	2.910	372,480.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	689,240	0.710	489,360.400	
CHINA POWER INTERNATIONAL	210,000	4.740	995,400.000	
AIR CHINA / HONG KONG	46,000	5.330	245,180.000	
ZTE CORP	44,288	21.600	956,620.800	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	245,500	18.140	4,453,370.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	203,250	15.200	3,089,400.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	597,205	4.700	2,806,863.500	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	110,250	8.640	952,560.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	60,000	32.850	1,971,000.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,638,530	5.300	35,184,209.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	55,000	158.200	8,701,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	206,000	7.210	1,485,260.000	

AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	98,000	5.040	493,920.000	
MINTH GROUP LTD	54,000	36.000	1,944,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	138,000	9.350	1,290,300.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	300,000	9.130	2,739,000.000	
BANK OF CHINA LTD	5,619,200	2.760	15,508,992.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	99,500	8.060	801,970.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	12.840	770,400.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	99,200	4.160	412,672.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	267,470	66.200	17,706,514.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,919,235	4.340	17,009,479.900	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	13.580	726,530.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.850	645,260.000	
CHINA COAL ENERGY CO	206,000	4.480	922,880.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	20.350	1,119,250.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	44,600	46.400	2,069,440.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	502,142	7.520	3,776,107.840	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	237,000	4.480	1,061,760.000	
CHINA CITIC BANK-H	579,800	3.480	2,017,704.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	29,000	6.120	177,480.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	47,500	245.200	11,647,000.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	71,800	129.000	9,262,200.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	21.200	424,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	169,028	8.770	1,482,375.560	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	272,000	2.530	688,160.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	264,000	5.080	1,341,120.000	
KINGSOFT CORP LTD	79,400	35.050	2,782,970.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	35,000	10.740	375,900.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	350,000	3.990	1,396,500.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	111,000	7.630	846,930.000	
DONGYUE GROUP	125,000	12.820	1,602,500.000	

BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	47,500	31.300	1,486,750.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	277,000	6.940	1,922,380.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	168,000	23.000	3,864,000.000	
CRRC CORP LTD - H	405,000	3.560	1,441,800.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	92,000	12.920	1,188,640.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	226,500	3.250	736,125.000	
SINOPHARM GROUP CO	112,400	16.740	1,881,576.000	
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY CORP LTD	169,000	5.920	1,000,480.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	216,000	6.000	1,296,000.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	260,527	8.620	2,245,742.740	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	7.740	1,164,870.000	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	108,000	4.580	494,640.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	255,000	17.180	4,380,900.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	84,100	14.080	1,184,128.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	186,000	15.400	2,864,400.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	45,200	5.210	235,492.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	90,000	8.060	725,400.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	122,500	40.500	4,961,250.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	65,000	21.350	1,387,750.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	340,156	3.070	1,044,278.920	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	68,800	17.220	1,184,736.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	81,000	12.460	1,009,260.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.770	692,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,902,000	2.670	5,078,340.000	

ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	37,000	62.300	2,305,100.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	6.750	695,250.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	44,600	33.600	1,498,560.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	143,500	20.800	2,984,800.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	206,000	5.420	1,116,520.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	194,000	6.860	1,330,840.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	675,000	2.340	1,579,500.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	34,500	37.600	1,297,200.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	244,000	4.680	1,141,920.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	216,500	4.520	978,580.000	
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	136,000	7.930	1,078,480.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	530,000	5.640	2,989,200.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	36,000	44.600	1,605,600.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	40.750	3,341,500.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	118,000	53.900	6,360,200.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	33,000	29.050	958,650.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	13.340	693,680.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	13.360	501,000.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	44,250	17.820	788,535.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,346,000	0.920	3,078,320.000	
XIAOMI CORP	968,800	19.200	18,600,960.000	
WUXI APPTec CO LTD	22,812	165.600	3,777,667.200	
WEIMOB INC	166,000	8.950	1,485,700.000	
MEITUAN	278,500	243.000	67,675,500.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	71,200	17.520	1,247,424.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	87,000	18.060	1,571,220.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	314,000	14.300	4,490,200.000	

INNOVENT BIOLOGICS INC	76,500	66.300	5,071,950.000	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	82,000	14.600	1,197,200.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	665,000	1.330	884,450.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	40,000	36.450	1,458,000.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	6.850	705,550.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	38.000	3,895,000.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	63,000	9.510	599,130.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	6,200	155.000	961,000.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	116,000	8.860	1,027,760.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	86,000	18.320	1,575,520.000	
CHINA FEIHE LTD	219,000	10.960	2,400,240.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,037,068	121.200	125,692,641.600	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,400	147.500	1,091,500.000	
JD.COM INC	118,000	312.200	36,839,600.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	120,000	45.200	5,424,000.000	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,500	32.000	496,000.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	15.000	750,000.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	30,100	86.300	2,597,630.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	148,200	33.050	4,898,010.000	
AKESO INC	20,000	42.850	857,000.000	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	77,000	11.800	908,600.000	
NETEASE INC	135,900	162.800	22,124,520.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	25,000	22.000	550,000.000	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	7.840	321,440.000	
NONGFU SPRING CO LTD	116,800	47.250	5,518,800.000	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	294,500	1.900	559,550.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	29,100	70.600	2,054,460.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	29,800	58.550	1,744,790.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	46,200	40.500	1,871,100.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	9,600	122.400	1,175,040.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	111,661	19.240	2,148,357.640	

	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-RTS	19,600	0.590	11,564.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	37,000	47.200	1,746,400.000	
	CGN POWER CO LTD	610,000	2.190	1,335,900.000	
	GF SECURITIES CO LTD	68,200	15.480	1,055,736.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	47,600	42.600	2,027,760.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	92,400	12.360	1,142,064.000	
	3SBIO INC	90,500	6.780	613,590.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	461,000	0.510	235,110.000	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	59.750	1,696,900.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	34,000	35.300	1,200,200.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.170	610,905.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	192,000	3.190	612,480.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	7.940	516,100.000	
	BOC AVIATION LTD	8,400	58.000	487,200.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	34,000	28.100	955,400.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	90,000	14.600	1,314,000.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	112,800	22.100	2,492,880.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	244,500	100.500	24,572,250.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	16,400	138.700	2,274,680.000	
	香港・ドル 小計	61,385,403		1,018,979,768.030 (14,836,345,422)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	40,000	304.000	12,160,000.000	
	ACER INC	202,532	29.750	6,025,327.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	46,554	368.000	17,131,872.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	29,616	554.000	16,407,264.000	
	ASIA CEMENT CORP	145,928	43.450	6,340,571.600	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	57,000	153.500	8,749,500.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	49,000	166.000	8,134,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	80,000	224.500	17,960,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	176,858	89.300	15,793,419.400	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	156.000	8,698,560.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	248,208	16.800	4,169,894.400	

CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	137,169	35.850	4,917,508.650	
CHINA STEEL CORP	795,058	34.200	27,190,983.600	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	157,011	30.800	4,835,938.800	
ADVANTECH CO LTD	23,675	380.500	9,008,337.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	335,304	24.300	8,147,887.200	
DELTA ELECTRONICS INC	131,663	271.000	35,680,673.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	90,000	77.800	7,002,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	274,427	114.000	31,284,678.000	
AU OPTRONICS CORP	534,194	22.200	11,859,106.800	
TAIWAN MOBILE CO LTD	103,800	98.300	10,203,540.000	
EVERGREEN MARINE CORP	170,820	140.000	23,914,800.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	139,824	28.750	4,019,940.000	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	31,768	228.000	7,243,104.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	618.000	9,468,996.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	38,285	508.000	19,448,780.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	255,633	104.000	26,585,832.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	234,594	80.000	18,767,520.000	
GIANT MANUFACTURING	21,151	332.000	7,022,132.000	
MEDIATEK INC	103,507	1,075.000	111,270,025.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	508,942	75.900	38,628,697.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	564,752	21.000	11,859,792.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	20,000	615.000	12,300,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	122,000	62.600	7,637,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	745,146	24.950	18,591,392.700	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	532,941	60.500	32,242,930.500	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	841,403	16.600	13,967,289.800	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	810,798	27.950	22,661,804.100	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	853,225	105.000	89,588,625.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	750,495	35.650	26,755,146.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	7,220	2,055.000	14,837,100.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	645,132	18.950	12,225,251.400	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	798,345	10.650	8,502,374.250	

INVENTEC CO LTD	225,005	25.550	5,748,877.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	127,845	62.700	8,015,881.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	623,443	15.950	9,943,915.850	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,354,048	25.950	35,137,545.600	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	773,806	24.100	18,648,724.600	
NAN YA PLASTICS CORP	345,828	84.400	29,187,883.200	
WISTRON CORP	230,916	29.250	6,754,293.000	
POU CHEN CORP	157,990	33.650	5,316,363.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	319,297	68.900	21,999,563.300	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	44,392	275.500	12,229,996.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	86,480	96.700	8,362,616.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	66,224	63.200	4,185,356.800	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	73,588	65.300	4,805,296.400	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	101,899	64.100	6,531,725.900	
TAIWAN CEMENT CORP	386,171	47.300	18,265,888.300	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,685,083	605.000	1,019,475,215.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	798,525	63.500	50,706,337.500	
WAN HAI LINES LTD	51,500	210.500	10,840,750.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	249,000	30.900	7,694,100.000	
YAGEO CORP	24,160	447.500	10,811,600.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	117,000	124.000	14,508,000.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	161,000	29.750	4,789,750.000	
INNOLUX CORPORATION	720,345	18.950	13,650,537.750	
WPG HOLDINGS CO LTD	118,203	50.400	5,957,431.200	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	15,000	572.000	8,580,000.000	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	15,969	292.000	4,662,948.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,000	1,940.000	9,700,000.000	
PEGATRON CORP	138,554	67.900	9,407,816.600	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,371	894.000	10,165,674.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	374.000	7,854,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	86,593	256.500	22,211,104.500	
ONENESS BIOTECH CO LTD	18,000	302.000	5,436,000.000	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,000	1,875.000	9,375,000.000	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,895.000	3,790,000.000	

	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	52,385	99.100	5,191,353.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	697,393	25.100	17,504,564.300	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	225,993	47.050	10,632,970.650	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	5,000	1,540.000	7,700,000.000	
	WIWYNN CORP	5,000	1,065.000	5,325,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	214,903	103.000	22,135,009.000	
	SILERGY CORP	6,000	4,370.000	26,220,000.000	
	MOMO.COM INC	3,000	1,620.000	4,860,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	14,000	813.000	11,382,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	11,000	403.000	4,433,000.000	
	台湾・ドル 小計	22,319,969		2,349,373,884.950 (9,617,866,810)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	220.730	1,581,088.990	
	BIDVEST GROUP LTD	15,192	184.930	2,809,456.560	
	CLICKS GROUP LTD	16,080	304.660	4,898,932.800	
	DISCOVERY LTD	30,465	137.000	4,173,705.000	
	GOLD FIELDS LTD	57,452	160.410	9,215,875.320	
	REMGRO LTD	28,949	127.950	3,704,024.550	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	51,798	59.860	3,100,628.280	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,869	151.320	3,006,577.080	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,061	1,898.600	11,507,414.600	
	MTN GROUP LTD	112,829	158.000	17,826,982.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	27,098	308.820	8,368,404.360	
	FIRSTRAND LTD	336,348	57.500	19,340,010.000	
	NASPERS LTD	14,757	2,519.540	37,180,851.780	
	NEDBANK GROUP LTD	32,060	167.220	5,361,073.200	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,537	1,798.470	6,361,188.390	
	SASOL LTD	42,391	282.800	11,988,174.800	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	38,000	201.610	7,661,180.000	
	MR PRICE GROUP LTD	14,601	203.700	2,974,223.700	
	STANDARD BANK GROUP LTD	83,701	133.420	11,167,387.420	
	SPAR GROUP LTD/THE	16,546	163.000	2,696,998.000	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	72,648	51.650	3,752,269.200	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	29,619	216.010	6,398,000.190	
	ABSA GROUP LTD	47,851	148.760	7,118,314.760	
	TIGER BRANDS LTD	12,981	177.020	2,297,896.620	
	SANLAM LTD	113,774	58.480	6,653,503.520	

IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	54,946	206.760	11,360,634.960	
KUMBA IRON ORE LTD	4,497	439.970	1,978,545.090	
RMI HOLDINGS	62,995	45.660	2,876,351.700	
VODACOM GROUP PTY LTD	48,278	132.350	6,389,593.300	
NEPI ROCKCASTLE PLC	33,357	103.650	3,457,453.050	
OLD MUTUAL LTD	367,072	11.690	4,291,071.680	
REINET INVESTMENTS SCA	7,218	278.160	2,007,758.880	
PEPKOR HOLDINGS LTD	100,374	21.510	2,159,044.740	
MULTICHOICE GROUP LTD	27,072	125.410	3,395,099.520	
SIBANYE STILLWATER LTD	184,207	48.320	8,900,882.240	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	28,727	197.970	5,687,084.190	
BID CORP LTD	20,786	315.150	6,550,707.900	
南アフリカ・ランド 小計	2,171,299		260,198,388.370 (1,852,612,525)	
合計	177,568,074		61,283,626,357 (61,283,626,357)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年12月13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	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	35,610.000	18,517.200	
		BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	71,220.000	30,624.600	
	タイ・パーツ 小計		106,830.000	49,141.800 (166,591)	
新株予約権証券 合計			106,830	166,591 (166,591)	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	89,400.000	2,036,532.000	
		BANCO INTER SA	23,700.000	888,987.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	32,300.000	1,032,308.000	
		ENERGISA SA	15,800.000	732,962.000	
		KLABIN SA	50,500.000	1,292,295.000	
	ブラジル・リアル 小計		211,700.000	5,983,084.000 (121,107,791)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	965,475.000	12,222,913.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	35,200.000	3,810,048.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	126,400.000	18,750,176.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	188,300.000	7,731,598.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	25,000.000	1,595,500.000	
メキシコ・ペソ 小計		1,340,375.000	44,110,235.500 (239,946,449)		
投資信託受益証券 合計			1,552,075	361,054,240	

				(361,054,240)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	4,856,302.000	
	メキシコ・ペソ 小計		235,400.000	4,856,302.000	(26,416,826)
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	168,453.000	2,442,568.500	
	南アフリカ・ランド 小計		168,453.000	2,442,568.500	(17,391,088)
投資証券 合計			403,853	43,807,914	(43,807,914)
合計				405,028,745	(405,028,745)

(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)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 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 65銘柄	6.77	-	-	-	7.53
アラブ首長国連邦・ディル ハム	株式 9銘柄	1.23	-	-	-	1.37
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.07	-	-	-	0.08
インド・ルピー	株式 106銘柄	10.99	-	-	-	12.23
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.29	-	-	-	1.44
オフショア・人民元	株式 376銘柄	4.88	-	-	-	5.43
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.77	-	-	-	0.86
クウェート・ディナール	株式 6銘柄	0.54	-	-	-	0.60
コロンビア・ペソ	株式 5銘柄	0.16	-	-	-	0.18
サウジアラビア・リアル	株式 36銘柄	2.84	-	-	-	3.17
タイ・バーツ	株式 42銘柄 新株予約権証 券 2銘柄	1.44 -	- 0.00	-	-	1.60
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.10	-	-	-	0.11
チリ・ペソ	株式 11銘柄	0.38	-	-	-	0.42
トルコ・リラ	株式 11銘柄	0.23	-	-	-	0.26
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.21	-	-	-	0.24
フィリピン・ペソ	株式 19銘柄	0.66	-	-	-	0.73
ブラジル・レアル	株式 46銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄	3.45 -	- -	- 0.18	- -	4.04
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.66	-	-	-	0.73
マレーシア・リンギット	株式 35銘柄	1.17	-	-	-	1.30

メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.33	-	-	-	1.91
	投資信託受益証券	5銘柄	-	-	0.35	-	
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.04	
ユーロ	株式	7銘柄	0.19	-	-	-	0.21
韓国・ウォン	株式	110銘柄	11.57	-	-	-	12.88
香港・ドル	株式	209銘柄	21.60	-	-	-	24.05
台湾・ドル	株式	87銘柄	14.00	-	-	-	15.59
南アフリカ・ランド	株式	37銘柄	2.70	-	-	-	3.03
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年12月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,199,523,550
コール・ローン	139,912,734
国債証券	104,964,749,194
未収利息	776,425,428
前払費用	501,339,595
流動資産合計	109,581,950,501
資産合計	109,581,950,501
負債の部	
流動負債	
未払金	1,611,117,737
未払解約金	3,492,000
流動負債合計	1,614,609,737
負債合計	1,614,609,737
純資産の部	
元本等	
元本	48,633,528,935
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,333,811,829
元本等合計	107,967,340,764
純資産合計	107,967,340,764
負債純資産合計	109,581,950,501

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年12月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	73,908,082,217円
同期中追加設定元本額	55,521,570,258円
同期中一部解約元本額	80,796,123,540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）	187,526,562円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,425,292,726円
たわらノーロード バランス（堅実型）	110,694,442円
たわらノーロード バランス（標準型）	302,358,548円
たわらノーロード バランス（積極型）	124,276,239円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	982,364円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,727,239円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	22,160,461円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,905,242円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,869,398円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	50,815,239円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	209,618,152円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	293,236,790円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	590,341,150円
投資のソムリエ	9,425,836,302円
クルーズコントロール	300,808,337円
投資のソムリエ<DC年金>	480,629,741円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	234,025,550円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	1,974,000円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	6,424,057円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	363,988,473円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,298,693,794円
ワールドアセットバランス（基本コース）	578,002,137円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,608,494,023円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	19,047,421円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	10,151,850円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	3,724,131円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	66,263,851円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,829,009,449円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	208,011,205円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	15,051,300円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	7,681,093円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,346,128円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	342,946円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	19,368,820,462円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	253,563,456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)	2,547,220,003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)	589,908,915円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	5,174,441円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	8,819,807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)	175,318,420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)	85,229,110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)	2,384,380,062円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	425,783,919円
計	48,633,528,935円
2. 受益権の総数	48,633,528,935口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年12月13日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	958,944,059	
合計	958,944,059	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年4月20日から2021年12月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年12月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2200円 (22,200円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

2021年12月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.875 06/06/25	6,000,000.000	6,042,840.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	10,000,000.000	9,565,600.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	6,000,000.000	6,039,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	11,800,000.000	12,163,381.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	12,000,000.000	10,728,000.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	10,800,000.000	10,107,180.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,100,000.000	8,244,423.000	

BRAZIL 5.625 02/21/47	8,600,000.000	8,629,928.000	
BRAZIL 6.0 04/07/26	8,800,000.000	9,879,188.000	
BRAZIL 7.125 01/20/37	4,300,000.000	5,182,295.500	
BRAZIL 8.25 01/20/34	5,200,000.000	6,822,920.000	
BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	5,783,520.000	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	6,426,105.000	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	10,000,000.000	9,068,200.000	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	9,000,000.000	8,171,010.000	
COLOMBIA 3.875 02/15/61	6,000,000.000	4,798,500.000	
COLOMBIA 4.125 02/22/42	5,000,000.000	4,351,800.000	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	5,000,000.000	4,227,800.000	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,000,000.000	6,291,630.000	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	8,000,000.000	8,207,280.000	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	13,000,000.000	12,191,920.000	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	6,688,500.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	7,000,000.000	7,029,890.000	
CROATIA 5.5 04/04/23	7,400,000.000	7,840,300.000	
CROATIA 6.0 01/26/24	8,400,000.000	9,237,614.400	
HUNGARY 5.375 02/21/23	7,358,000.000	7,754,610.910	
HUNGARY 5.375 03/25/24	9,380,000.000	10,227,633.080	
HUNGARY 5.75 11/22/23	11,000,000.000	11,972,576.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	5,000,000.000	8,243,005.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	4,000,000.000	3,882,364.400	
INDONESIA 2.85 02/14/30	5,000,000.000	5,199,500.100	
INDONESIA 3.05 03/12/51	6,000,000.000	5,903,940.120	
INDONESIA 3.4 09/18/29	4,000,000.000	4,305,400.000	
INDONESIA 3.5 01/11/28	5,200,000.000	5,607,472.000	
INDONESIA 3.7 10/30/49	2,000,000.000	2,106,670.080	
INDONESIA 3.85 10/15/30	6,000,000.000	6,722,370.000	
INDONESIA 4.1 04/24/28	4,000,000.000	4,457,260.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	7,800,000.000	8,430,104.430	
INDONESIA 4.2 10/15/50	5,000,000.000	5,680,992.200	
INDONESIA 4.35 01/08/27	6,000,000.000	6,691,980.000	
INDONESIA 4.35 01/11/48	4,000,000.000	4,593,300.000	
INDONESIA 4.45 04/15/70	4,000,000.000	4,727,659.920	
INDONESIA 4.75 01/08/26	7,800,000.000	8,730,774.000	
INDONESIA 4.75 02/11/29	5,000,000.000	5,800,952.300	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,400,000.000	6,693,327.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	6,300,000.000	7,890,561.000	
INDONESIA 5.35 02/11/49	3,000,000.000	3,915,480.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	6,200,000.000	6,811,940.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,200,000.000	5,794,887.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	5,500,000.000	8,097,712.750	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,500,000.000	9,872,297.500	
PANAMA 2.252 09/29/32	9,000,000.000	8,571,690.000	
PANAMA 3.16 01/23/30	7,000,000.000	7,239,400.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	7,200,000.000	7,635,672.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	4,100,000.000	4,444,933.000	
PANAMA 4.5 04/01/56	8,000,000.000	8,894,960.000	

PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	10,348,017.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	6,900,000.000	9,217,710.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	3,800,000.000	4,545,522.000	
PERU 1.862 12/01/32	5,000,000.000	4,588,550.000	
PERU 2.392 01/23/26	5,000,000.000	5,093,800.000	
PERU 2.78 12/01/60	8,000,000.000	7,066,400.000	
PERU 2.783 01/23/31	13,000,000.000	12,994,800.000	
PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	5,085,650.000	
PERU 3.3 03/11/41	6,000,000.000	6,006,120.000	
PERU 5.625 11/18/50	8,000,000.000	11,257,280.000	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	4,000,000.000	3,853,722.640	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	4,000,000.000	4,126,945.200	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	5,000,000.000	4,724,882.400	
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	5,000,000.000	4,893,678.300	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	7,000,000.000	7,524,402.620	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,000,000.000	6,534,780.000	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,000,000.000	5,617,774.500	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,800,000.000	7,594,800.320	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	7,800,000.000	8,334,861.670	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	3,800,000.000	4,699,735.800	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,000,000.000	8,305,702.380	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	7,100,000.000	10,297,175.440	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,800,000.000	10,545,492.290	
ROMANIA 3.0 02/14/31	8,000,000.000	8,168,832.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	7,000,000.000	7,213,801.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	4,600,000.000	4,922,000.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	5,600,000.000	6,685,201.600	
ROMANIA 6.125 01/22/44	4,400,000.000	5,830,514.800	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	8,853,000.000	10,092,420.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	9,400,000.000	10,220,150.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	11,400,000.000	12,682,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,400,000.000	11,432,200.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	10,400,000.000	10,996,190.400	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	14,000,000.000	16,728,488.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	21,000,000.000	26,873,238.000	

RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	8,000,000.000	10,515,312.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	6,200,000.000	8,467,457.800	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	8,200,000.000	8,312,873.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	9,000,000.000	9,282,375.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	6,400,000.000	6,833,600.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	5,200,000.000	4,973,774.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	9,000,000.000	8,610,300.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	6,400,000.000	7,121,280.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	9,200,000.000	10,191,024.000	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	3,000,000.000	3,118,608.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	13,000,000.000	12,656,020.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	8,000,000.000	8,208,640.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	7,200,000.000	7,674,408.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	6,200,000.000	6,671,417.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	6,298,810.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	10,000,000.000	9,263,350.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	5,000,000.000	5,376,950.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	8,000,000.000	8,796,560.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	9,400,000.000	10,376,519.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	5,000,000.000	5,299,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	10,000,000.000	11,148,850.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	9,000,000.000	9,651,870.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	8,400,000.000	9,002,070.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	7,000,000.000	7,896,700.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	8,000,000.000	9,150,160.000	

	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,800,000.000	11,351,242.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	9,900,000.000	12,338,172.000	
	アメリカ・ドル 小計	846,991,000.000 (96,184,297,960)	924,310,929.850 (104,964,749,194)	
国債証券 合計		96,184,297,960 (96,184,297,960)	104,964,749,194 (104,964,749,194)	
合計			104,964,749,194 (104,964,749,194)	

(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 118銘柄	97.22	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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）

2021年12月30日現在

資産総額	8,529,139,131円
負債総額	82,898,067円
純資産総額（ - ）	8,446,241,064円
発行済数量	7,114,465,081口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1872円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2021年12月30日現在

資産総額	25,923,571,420円
負債総額	223,634,911円
純資産総額（ - ）	25,699,936,509円
発行済数量	23,449,288,326口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0960円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産総額	749,795,297,281円
負債総額	2,330,279円
純資産総額（ - ）	749,792,967,002円
発行済数量	122,896,722,560口
1口当たり純資産額（ / ）	6.1010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

2021年12月30日現在

資産総額	451,508,680,022円
負債総額	8,834,544,979円
純資産総額（ - ）	442,674,135,043円
発行済数量	309,481,606,915口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4304円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産総額	93,005,711,660円
負債総額	973,654,511円
純資産総額（ - ）	92,032,057,149円
発行済数量	51,317,999,603口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7934円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産総額	69,346,195,896円
負債総額	90,768,342円
純資産総額（ - ）	69,255,427,554円
発行済数量	48,217,272,044口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4363円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産総額	146,677,812,362円
負債総額	3,580,856,124円
純資産総額(-)	143,096,956,238円
発行済数量	63,766,266,124口
1口当たり純資産額(/)	2.2441円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6)受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2021年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(2021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。

2021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	1,506,807,208,638
追加型株式投資信託	825	15,911,064,690,034
単位型公社債投資信託	28	59,752,056,358
単位型株式投資信託	220	1,332,625,264,209
合計	1,099	18,810,249,219,239

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．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第36期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

重要な会計方針

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

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります）を採用しております。確定拠出型の制度としては確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 3.76%

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
b. 発生原因	被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。	
c. のれんの償却方法及び償却期間	20年間の均等償却	

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

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

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円
(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

(2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,149,555千円	5,016,672千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,648
金銭の信託		25,866
未収委託者報酬		18,882
未収運用受託報酬		2,911
未収投資助言報酬		319
未収収益		15
前払費用		996
その他		2,470
	流動資産計	80,112
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	792
器具備品	1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		4,193
ソフトウェア仮勘定		3,475
電話加入権		714
電話加入権		3
投資その他の資産		
投資有価証券		10,724
関係会社株式		261
長期差入保証金		5,299
繰延税金資産		1,273
繰延税金資産		3,311
その他		578
	固定資産計	15,895
資産合計		96,007

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,845
未払金	7,922
未払収益分配金	0
未払償還金	9
未払手数料	7,759
その他未払金	153
未払費用	7,337
未払法人税等	3,423
未払消費税等	1,234
契約負債	20
賞与引当金	836
役員賞与引当金	33
	流動負債計
	22,653
固定負債	
退職給付引当金	2,391
時効後支払損引当金	147
	固定負債計
	2,538
負債合計	25,192
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	49,261
利益準備金	123
その他利益剰余金	49,138
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	17,458
	株主資本計
	70,814
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	70,814
負債・純資産合計	96,007

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	54,995	
運用受託報酬	7,193	
投資助言報酬	569	
その他営業収益	6	
		営業収益計 62,765
営業費用		
支払手数料	22,800	
広告宣伝費	126	
公告費	0	
調査費	17,656	
調査費	4,722	
委託調査費	12,934	
委託計算費	281	
営業雑経費	437	
通信費	17	
印刷費	315	
協会費	33	
諸会費	17	
支払販売手数料	52	
		営業費用計 41,301
一般管理費		
給料	4,865	
役員報酬	82	
給料・手当	4,565	
賞与	217	
交際費	1	
寄付金	4	
旅費交通費	13	
租税公課	292	
不動産賃借料	892	
退職給付費用	248	
固定資産減価償却費	1 670	
福利厚生費	16	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	836	
役員賞与引当金繰入額	33	
機器リース料	0	
事務委託費	1,971	
事務用消耗品費	26	
器具備品費	0	
諸経費	99	
		一般管理費計 9,973
営業利益		11,490

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	7	
受取配当金	548	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	10	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	288	
雑収入	2	
営業外収益計		884
経常利益		12,374
特別損失		
固定資産除却損	5	
ゴルフ会員権売却損	3	
オフィス再編費用	5	
特別損失計		13
税引前中間純利益		12,360
法人税、住民税及び事業税		3,254
法人税等調整額		364
法人税等合計		3,619
中間純利益		8,741

(3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280
中間純利益							8,741
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	-	-	-	-	-	-	2,538
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,458

	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	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
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	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

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 … 8～18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、それぞれ発生の日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. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

当社は、当中間会計期間において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当中間会計期間において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ124百万円減少しております。

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識基準に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計方針の変更による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	520百万円
	器具備品	1,004百万円

(中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1. 減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当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37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	25,866	25,866	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

（注）現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021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5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

（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

2021年4月1日から2021年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間
 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬（注）	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6.重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

（セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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37期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02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37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,741百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の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

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2021年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
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2021年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

名称	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社
資本金の額	200百万円（2021年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

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

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年1月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（基本コース）の2021年6月12日から2021年12月13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2021年12月13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）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年1月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2021年6月12日から2021年12月13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2021年12月13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）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月25日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	丘本 正彦 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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021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2021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(2021年4月1日から2021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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記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。