

【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9月13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9月14日から2023年3月10日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

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。

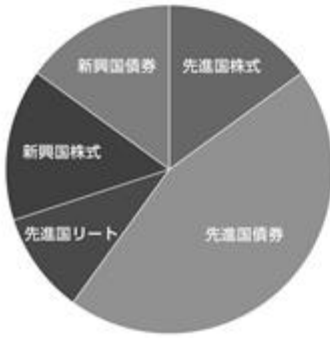
●各コース間でスイッチングが可能です。

※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。

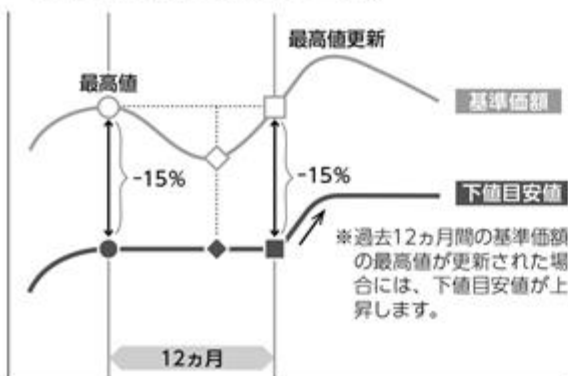
*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(リスク抑制コース)の下値目安値について

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

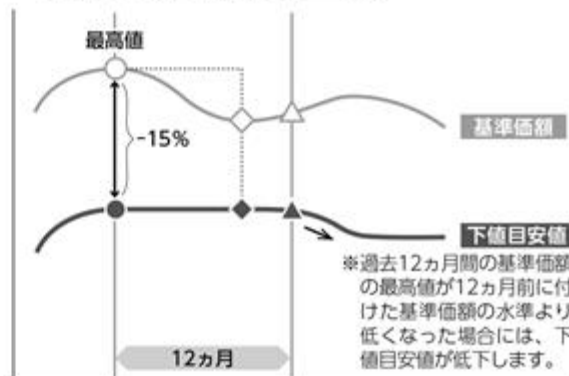
※(基本コース)は、下値目安値を定めておりません。
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

下値目安値が上昇するケース



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

下値目安値が低下するケース



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

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

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

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

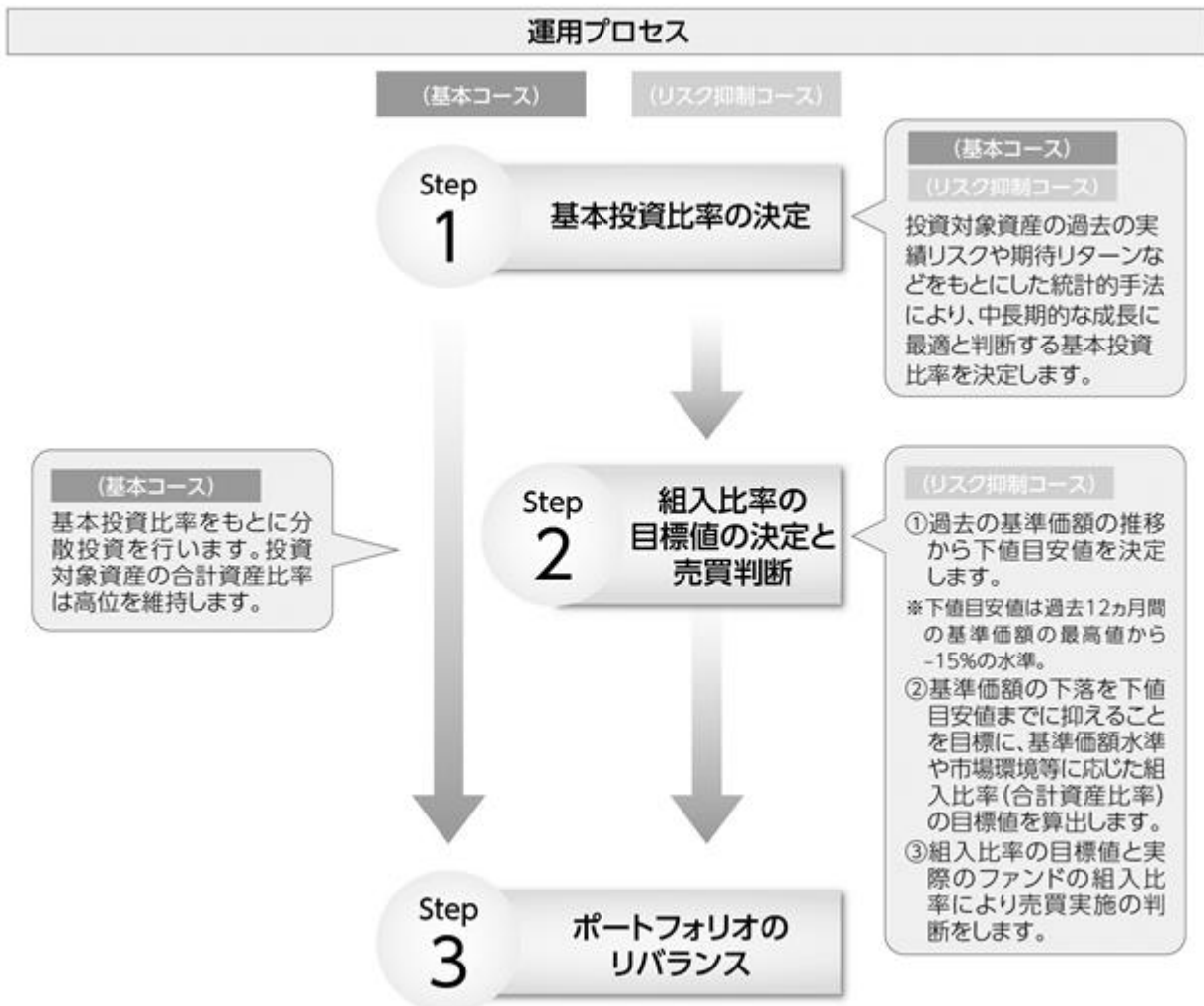
4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

5 年2回決算を行います。

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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



商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

各ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本除く) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	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。

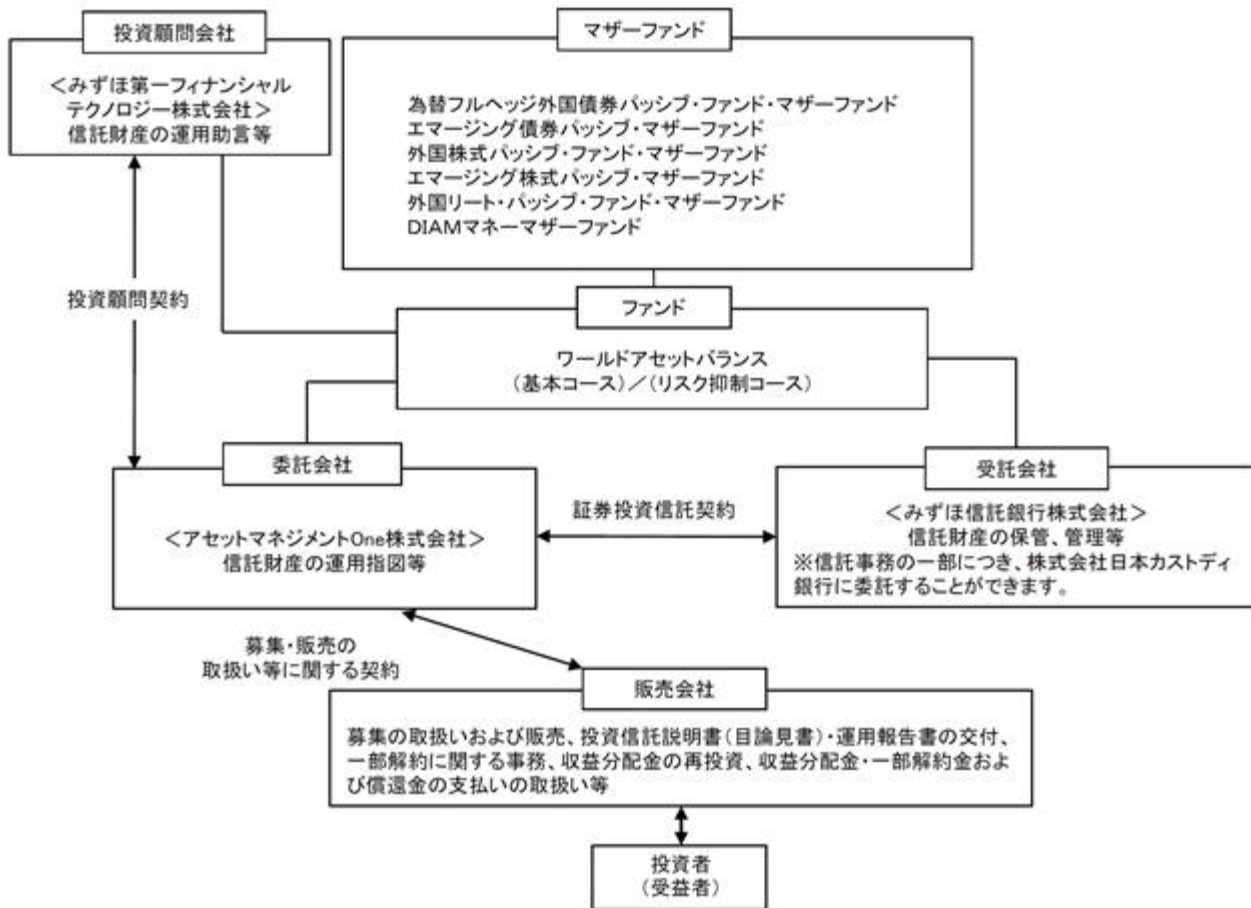
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

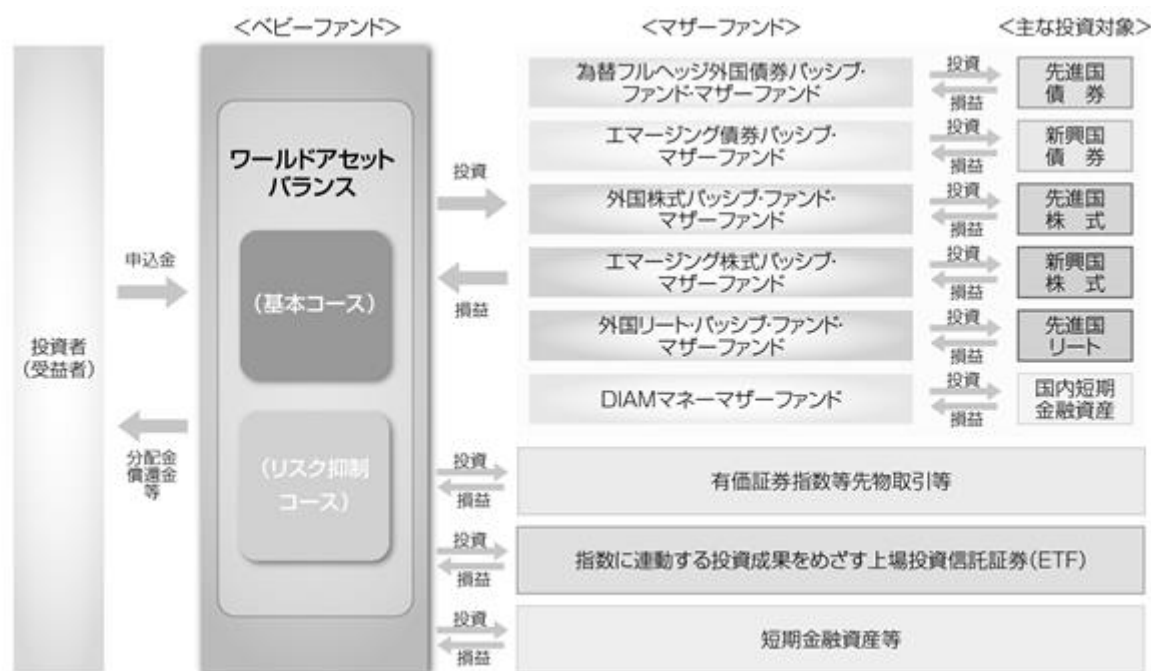
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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（2022年6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

(2022年6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

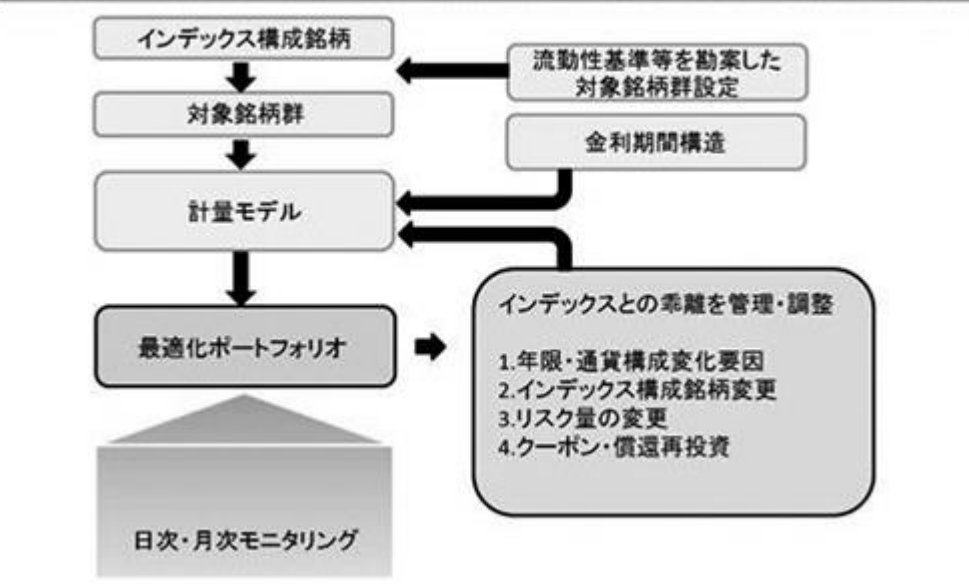
なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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。

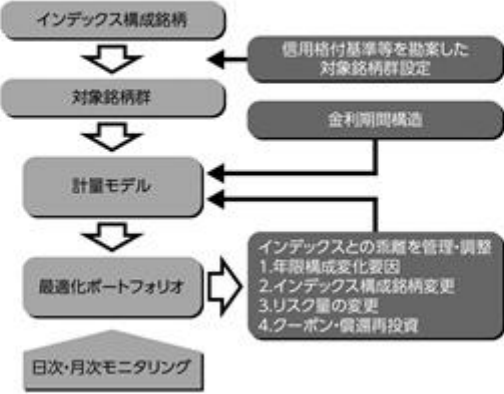
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

(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: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] 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します。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債等への投資は、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

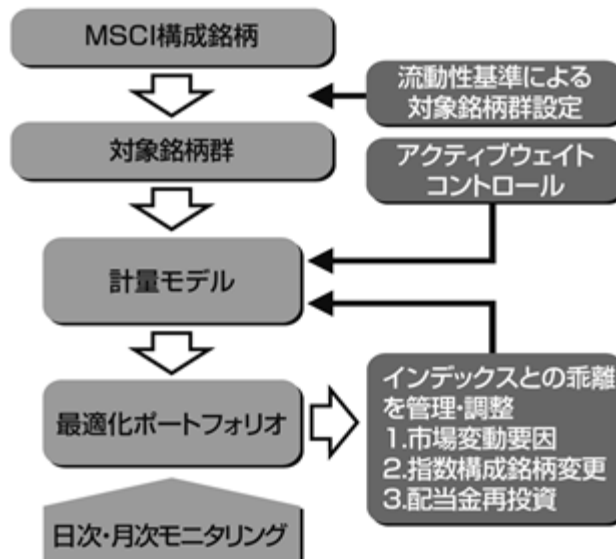
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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、MSCIEマージン・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
------	--

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

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

	<p>認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D F["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --> D G[日次・月次モニタリング] --> D </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 REIT インデックスは、S&P Globalの一部門である S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC またはその関連会社 (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's[®] および S&P[®] は、S&P Global の一部門であるスタンダード & プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones[®] は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズ LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社 (総称して「S&P Dow Jones Indices」) によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indices は、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡する S & P 先進国 REIT 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 REIT 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 REIT 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 REIT 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 REIT 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 REIT 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ます。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 R E I Tインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日次・月次モニタリング] 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] --> 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縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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2022年6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、）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

(5) 【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

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

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第29条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファ

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

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

資金の借入れ(約款第35条)

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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

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

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

・金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

・リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

・為替リスク

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

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

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

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

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

・信用リスク

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

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

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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。

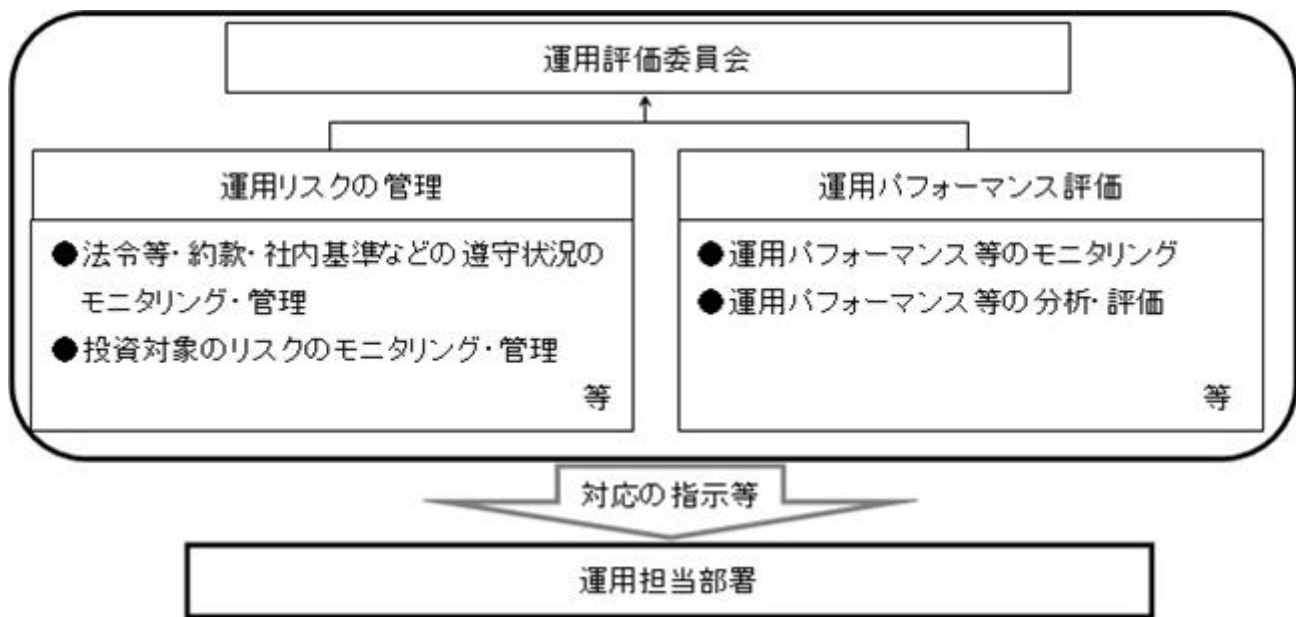
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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。



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

リスク管理体制は2022年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

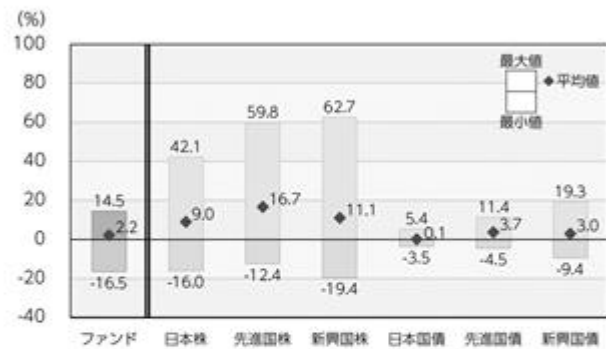
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

（基本コース）

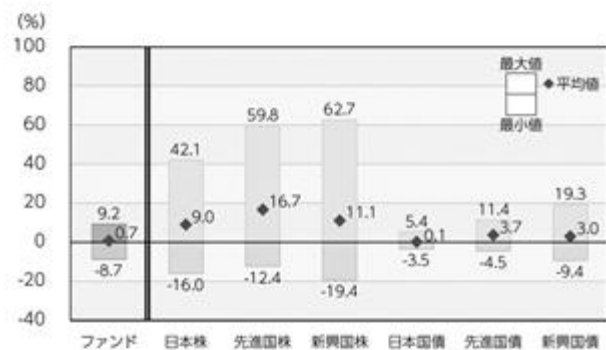


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年1月～2022年6月
代表的な資産クラス:2017年7月～2022年6月

（リスク抑制コース）



ファンド:2018年1月～2022年6月
代表的な資産クラス:2017年7月～2022年6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	東京株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	[MSCIコクサイ・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	[MSCIエマージング・マーケット・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	[NOMURA-BPI国債]は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	[FTSE世界国債インデックス(除く日本)]は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド]は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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、2022年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2022年6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	41,028,739	0.62
内 アメリカ	41,028,739	0.62
親投資信託受益証券	6,500,658,472	98.10
内 日本	6,500,658,472	98.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	85,202,411	1.29
純資産総額	6,626,889,622	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	7,506,500,000	34.33
内 日本	7,506,500,000	34.33
投資信託受益証券	63,239,785	0.29
内 アメリカ	63,239,785	0.29
親投資信託受益証券	4,151,060,781	18.99
内 日本	4,151,060,781	18.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,143,587,281	46.39
純資産総額	21,864,387,847	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

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	692,162,095,497	95.74
内 アメリカ	485,870,481,410	67.21
内 イギリス	31,792,642,199	4.40
内 カナダ	27,811,524,068	3.85
内 スイス	24,029,422,611	3.32
内 フランス	21,672,350,469	3.00
内 ドイツ	16,204,817,345	2.24
内 オーストラリア	15,425,133,435	2.13
内 アイルランド	12,387,184,773	1.71
内 オランダ	12,284,799,406	1.70
内 スウェーデン	6,671,993,985	0.92
内 デンマーク	5,750,056,218	0.80
内 スペイン	5,284,826,229	0.73
内 香港	5,214,165,574	0.72
内 イタリア	3,615,190,731	0.50
内 ジャージー	2,656,854,853	0.37
内 フィンランド	2,551,498,643	0.35
内 シンガポール	2,264,474,883	0.31

内 ノルウェー	1,789,777,485	0.25
内 ベルギー	1,762,532,409	0.24
内 ケイマン諸島	1,587,289,050	0.22
内 イスラエル	1,575,439,284	0.22
内 パミュータ	983,437,565	0.14
内 オランダ領キュラソー	787,746,681	0.11
内 ルクセンブルグ	525,706,418	0.07
内 ニュージーランド	484,705,917	0.07
内 ポルトガル	407,029,312	0.06
内 オーストリア	381,250,508	0.05
内 リベリア	135,275,140	0.02
内 マン島	129,683,361	0.02
内 パナマ	124,805,535	0.02
投資信託受益証券	1,266,751,503	0.18
内 オーストラリア	902,072,144	0.12
内 シンガポール	364,679,359	0.05
投資証券	16,319,599,257	2.26
内 アメリカ	15,223,073,390	2.11
内 イギリス	414,484,035	0.06
内 フランス	273,708,287	0.04
内 香港	264,574,909	0.04
内 ベルギー	72,437,782	0.01
内 カナダ	71,320,854	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	13,178,228,068	1.82
純資産総額	722,926,674,325	100.00

その他資産の投資状況

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	13,701,455,279	1.90
内 アメリカ	10,027,938,240	1.39
内 ドイツ	1,966,857,180	0.27
内 カナダ	735,343,200	0.10
内 イギリス	661,634,459	0.09
内 オーストラリア	309,682,200	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

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	393,295,551,947	103.93
内 アメリカ	200,067,217,678	52.87
内 フランス	34,182,475,800	9.03
内 イタリア	32,188,828,869	8.51
内 ドイツ	25,709,402,670	6.79
内 スペイン	20,639,566,753	5.45
内 イギリス	19,623,534,684	5.19

内 中国	8,652,574,110	2.29
内 カナダ	8,113,447,854	2.14
内 ベルギー	8,000,852,623	2.11
内 オランダ	6,869,288,360	1.82
内 オーストラリア	5,956,290,439	1.57
内 オーストリア	5,032,542,785	1.33
内 メキシコ	3,129,895,266	0.83
内 アイルランド	2,691,992,416	0.71
内 フィンランド	2,107,946,618	0.56
内 マレーシア	2,023,769,471	0.53
内 シンガポール	1,726,395,336	0.46
内 ポーランド	1,636,114,199	0.43
内 イスラエル	1,569,250,735	0.41
内 デンマーク	1,495,372,342	0.40
内 スウェーデン	1,069,537,880	0.28
内 ノルウェー	809,255,059	0.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,868,507,404	3.93
純資産総額	378,427,044,543	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

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	6,652,230,662	10.00
内 オーストラリア	4,146,678,747	6.23
内 シンガポール	2,445,065,397	3.68
内 香港	60,486,518	0.09
投資証券	61,626,103,533	92.63
内 アメリカ	52,835,276,358	79.41
内 イギリス	3,475,449,077	5.22
内 カナダ	1,257,958,774	1.89
内 フランス	1,082,052,441	1.63
内 香港	973,996,049	1.46
内 ベルギー	846,427,769	1.27
内 スペイン	269,937,879	0.41
内 ニュージーランド	234,907,451	0.35
内 ガーンジー	185,150,621	0.28
内 韓国	163,172,304	0.25
内 オランダ	130,449,005	0.20
内 イスラエル	81,435,439	0.12
内 ドイツ	40,974,420	0.06
内 アイルランド	28,270,046	0.04
内 イタリア	20,645,900	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,746,525,489	2.63
純資産総額	66,531,808,706	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

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	59,809,891,716	91.45
内 ケイマン諸島	12,273,899,487	18.77
内 台湾	8,599,128,083	13.15
内 中国	7,884,730,832	12.06
内 インド	7,614,034,075	11.64
内 韓国	6,806,650,424	10.41
内 ブラジル	2,829,239,119	4.33
内 サウジアラビア	2,590,679,816	3.96
内 南アフリカ	2,075,707,250	3.17
内 タイ	1,141,507,761	1.75
内 インドネシア	1,093,678,825	1.67
内 メキシコ	1,002,278,727	1.53
内 マレーシア	873,830,443	1.34
内 香港	760,564,371	1.16
内 アラブ首長国連邦	758,041,341	1.16
内 カタール	616,414,192	0.94
内 クエート	485,930,391	0.74
内 フィリピン	439,014,540	0.67
内 ポーランド	352,240,995	0.54
内 パミュータ	339,955,860	0.52
内 チリ	309,184,080	0.47
内 アメリカ	223,873,277	0.34
内 トルコ	160,920,613	0.25
内 ギリシャ	152,152,897	0.23
内 チェコ	100,525,514	0.15
内 コロンビア	99,801,757	0.15
内 ハンガリー	98,974,303	0.15
内 ルクセンブルグ	63,506,077	0.10
内 エジプト	32,608,266	0.05
内 シンガポール	19,015,898	0.03
内 ペルー	11,802,502	0.02
内 オランダ	0	0.00
内 ロシア	0	0.00
内 キプロス	0	0.00
内 イギリス領バージン諸島	0	0.00
投資信託受益証券	339,600,713	0.52
内 メキシコ	235,203,494	0.36
内 ブラジル	104,397,219	0.16
投資証券	58,137,656	0.09
内 メキシコ	31,536,386	0.05
内 南アフリカ	26,601,270	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,193,358,952	7.94
純資産総額	65,400,989,037	100.00

その他資産の投資状況

2022年6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）	5,087,698,412	7.78

内 アメリカ	5,087,698,412	7.78
--------	---------------	------

（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

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	120,088,848,063	106.56
内 メキシコ	11,609,588,728	10.30
内 インドネシア	10,180,059,364	9.03
内 サウジアラビア	9,950,896,860	8.83
内 カタール	9,897,954,191	8.78
内 アラブ首長国連邦	9,421,877,111	8.36
内 ブラジル	9,281,906,322	8.24
内 フィリピン	8,766,454,697	7.78
内 パナマ	7,619,133,152	6.76
内 コロンビア	7,237,633,943	6.42
内 南アフリカ	6,885,382,273	6.11
内 ペルー	6,441,821,144	5.72
内 チリ	6,079,297,809	5.39
内 ドミニカ共和国	4,362,982,750	3.87
内 ハンガリー	4,134,282,528	3.67
内 ルーマニア	3,246,152,705	2.88
内 ウルグアイ	2,587,173,541	2.30
内 クロアチア	1,647,179,173	1.46
内 中国	739,071,772	0.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,390,551,447	6.56
純資産総額	112,698,296,616	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（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）

2022年6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	2,297,070,590	1.2642 2,903,956,640	1.2673 2,911,077,558	- -	43.93
2	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	509,349,876	2.0126 1,025,117,561	1.9804 1,008,716,494	- -	15.22
3	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	688,931,951	1.4602 1,006,047,328	1.4327 987,032,806	- -	14.89

4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	169,383,556	5.8720 994,620,241	5.8103 984,169,275	- -	14.85
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	355,965,633	1.7138 610,089,498	1.7127 609,662,339	- -	9.20
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	13,300	3,165.23 42,097,631	3,084.86 41,028,739	- -	0.62

(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

2022年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.62
親投資信託受益証券	98.10
合計	98.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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)

2022年6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	1059回 国庫短期証券 日本	国債証 券	5,000,000,000	100.06 5,003,400,000	100.08 5,004,000,000	- 2023/2/20	22.89
2	1074回 国庫短期証券 日本	国債証 券	2,500,000,000	100.08 2,502,125,000	100.10 2,502,500,000	- 2023/4/20	11.45
3	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,473,306,935	1.2641 1,862,554,627	1.2673 1,867,121,878	- -	8.54
4	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	325,064,388	2.0125 654,224,587	1.9804 643,757,513	- -	2.94
5	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	108,008,871	5.8719 634,228,090	5.8103 627,563,943	- -	2.87
6	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	415,453,317	1.4603 606,686,479	1.4327 595,219,967	- -	2.72
7	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	243,707,293	1.7139 417,689,930	1.7127 417,397,480	- -	1.91
8	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	20,500	3,165.23 64,887,326	3,084.86 63,239,785	- -	0.29

(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

2022年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	34.33
投資信託受益証券	0.29
親投資信託受益証券	18.99
合計	53.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2022年6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	1,818,926	22,621.07 41,146,061,913	19,029.95 34,614,082,474	- -	4.79
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	793,902	39,846.78 31,634,438,806	35,572.33 28,240,949,330	- -	3.91
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	1,021,148	20,545.05 20,979,541,827	14,887.18 15,202,019,801	- -	2.10
4	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	33,515	362,753.43 12,157,681,315	305,347.22 10,233,712,091	- -	1.42
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	31,669	363,010.09 11,496,166,780	306,864.36 9,718,087,682	- -	1.34
6	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	97,954	116,910.36 11,451,837,650	93,690.03 9,177,314,138	- -	1.27

7	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロ バイ ダー/ヘル スケア ア・サー ビス	104,932	65,549.05 6,878,192,975	70,487.24 7,396,367,361	- -	1.02
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	292,763	22,915.76 6,708,888,921	24,190.99 7,082,227,742	- -	0.98
9	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	278,944	32,108.75 8,956,544,681	21,242.80 5,925,553,165	- -	0.82
10	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	257,467	29,024.13 7,472,756,599	22,407.31 5,769,145,252	- -	0.80
11	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	472,048	11,091.07 5,235,520,769	12,044.24 5,685,460,158	- -	0.79
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	143,802	43,093.49 6,196,930,062	37,380.61 5,375,406,939	- -	0.74
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	266,983	21,168.69 5,651,681,756	19,435.89 5,189,053,821	- -	0.72
14	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	329,013	20,171.30 6,636,621,329	15,759.20 5,184,982,985	- -	0.72
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	313,579	16,785.48 5,263,574,570	16,095.67 5,047,267,238	- -	0.70
16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	184,882	30,288.05 5,599,715,726	27,267.65 5,041,299,516	- -	0.70
17	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	627,475	6,863.16 4,306,462,619	6,962.47 4,368,781,636	- -	0.60
18	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	217,032	19,566.00 4,246,448,328	20,089.22 4,360,004,984	- -	0.60
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	116,374	46,552.23 5,417,470,347	37,432.55 4,356,175,759	- -	0.60
20	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	97,315	50,131.68 4,878,565,364	44,091.60 4,290,774,170	- -	0.59

21	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	197,294	19,839.55 3,914,225,475	21,067.85 4,156,561,423	- -	0.57
22	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	90,317	33,874.17 3,059,413,637	44,147.63 3,987,282,401	- -	0.55
23	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	458,965	8,340.00 3,827,768,790	8,573.93 3,935,136,719	- -	0.54
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	78,751	48,969.04 3,856,361,551	45,773.87 3,604,738,823	- -	0.50
25	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	281,868	10,739.70 3,027,178,555	12,644.26 3,564,014,194	- -	0.49
26	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	809,408	6,216.06 5,031,333,832	4,354.62 3,524,668,150	- -	0.49
27	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	153,973	22,713.44 3,497,257,075	22,788.65 3,508,837,791	- -	0.49
28	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	467,890	7,217.93 3,377,197,713	6,962.47 3,257,674,392	- -	0.45
29	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサイ エンス・ツ ール/サー ビス	43,686	76,534.55 3,343,488,669	73,249.54 3,199,979,649	- -	0.44
30	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生 活必需品 小売り	49,475	68,954.55 3,411,526,630	64,217.73 3,177,172,251	- -	0.44

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年6月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.74
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.26
合計	98.18

(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

2022年6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.17
銀行		5.79
医薬品		5.78
コンピュータ・周辺機器		5.04
石油・ガス・消耗燃料		4.97

半導体・半導体製造装置	4.20
インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.80
情報技術サービス	3.72
保険	3.17
資本市場	3.15
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.47
インターネット販売・通信販売	2.43
ヘルスケア機器・用品	2.30
化学	2.04
バイオテクノロジー	1.99
電力	1.93
飲料	1.88
自動車	1.87
食品	1.74
ホテル・レストラン・レジャー	1.68
金属・鉱業	1.58
航空宇宙・防衛	1.57
機械	1.55
専門小売り	1.55
食品・生活必需品小売り	1.52
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.48
各種電気通信サービス	1.37
繊維・アパレル・贅沢品	1.27
家庭用品	1.22
娯楽	1.07
陸運・鉄道	1.04
各種金融サービス	0.98
総合公益事業	0.90
コングロマリット	0.86
メディア	0.84
タバコ	0.77
電気設備	0.72
専門サービス	0.68
通信機器	0.64
航空貨物・物流サービス	0.61
パーソナル用品	0.57
電子装置・機器・部品	0.52
建設関連製品	0.49
複合小売り	0.48
商業サービス・用品	0.48
消費者金融	0.40
不動産管理・開発	0.37
商社・流通業	0.33
無線通信サービス	0.32
家庭用耐久財	0.28
容器・包装	0.27
エネルギー設備・サービス	0.24
建設・土木	0.24
建設資材	0.22
自動車部品	0.19

独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
ガス	0.15
運送インフラ	0.15
水道	0.11
紙製品・林産品	0.11
販売	0.11
海運業	0.08
ヘルスケア・テクノロジー	0.07
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	95.74

(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

2022年6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 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	2,417,869,200	83.84 2,027,232,206	85.46 2,066,522,581	1.25 2031/8/15	0.55
2	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	2,225,150,400	80.81 1,798,199,667	82.32 1,831,924,602	0.625 2030/8/15	0.48
3	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	1,940,312,000	90.39 1,753,960,554	92.28 1,790,647,974	0.5 2029/5/25	0.47
4	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,957,257,600	87.06 1,704,037,398	88.72 1,736,607,376	1.625 2031/5/15	0.46
5	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,914,886,800	88.88 1,701,987,448	89.91 1,721,677,708	1.875 2032/2/15	0.45
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,992,794,400	84.41 1,682,198,058	86.08 1,715,515,731	1.375 2031/11/15	0.45
7	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	1,816,477,200	91.92 1,669,739,900	92.92 1,687,904,672	1.5 2027/1/31	0.45
8	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,947,690,000	83.73 1,630,886,047	85.32 1,661,775,184	1.125 2031/2/15	0.44
9	US T N/B 0.25 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,678,430,400	96.14 1,613,653,475	96.29 1,616,276,022	0.25 2023/11/15	0.43
10	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	1,861,581,600	80.57 1,500,027,547	83.64 1,557,038,484	2.375 2051/5/15	0.41
11	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,503,480,000	97.14 1,460,607,320	98.32 1,478,343,693	2.875 2028/5/15	0.39
12	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,097,132,300	131.40 1,441,647,202	134.29 1,473,436,610	5.75 2032/10/25	0.39
13	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	1,489,812,000	98.18 1,462,809,157	98.38 1,465,718,938	2.125 2024/3/31	0.39
14	US T N/B 0.125 08/31/23 アメリカ	国債証券	1,508,947,200	96.60 1,457,784,459	96.72 1,459,493,809	0.125 2023/8/31	0.39
15	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	1,697,565,600	81.35 1,381,062,454	82.78 1,405,398,635	0.625 2030/5/15	0.37

16	US T N/B 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,469,310,000	94.58 1,389,703,239	94.85 1,393,778,282	0.25 2024/5/15	0.37
17	US T N/B 2.0 08/15/51 アメリカ	国債証券	1,791,874,800	73.76 1,321,779,863	76.56 1,371,904,143	2 2051/8/15	0.36
18	US T N/B 2.5 01/31/24 アメリカ	国債証券	1,366,800,000	99.00 1,353,238,774	99.10 1,354,626,937	2.5 2024/1/31	0.36
19	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,615,557,600	82.25 1,328,796,126	83.83 1,354,417,851	0.875 2030/11/15	0.36
20	US T N/B 1.25 04/30/28 アメリカ	国債証券	1,503,480,000	88.60 1,332,106,764	89.71 1,348,903,462	1.25 2028/4/30	0.36
21	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,366,800,000	97.57 1,333,697,812	98.08 1,340,638,586	2.25 2024/11/15	0.35
22	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	1,454,275,200	90.60 1,317,652,850	91.50 1,330,718,610	0.75 2026/3/31	0.35
23	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	1,366,800,000	96.59 1,320,243,375	97.28 1,329,746,899	2.125 2025/5/15	0.35
24	US T N/B 1.25 05/31/28 アメリカ	国債証券	1,482,978,000	88.45 1,311,740,382	89.57 1,328,423,884	1.25 2028/5/31	0.35
25	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,366,800,000	95.89 1,310,739,836	96.58 1,320,189,974	2 2025/8/15	0.35
26	US T N/B 0.125 10/15/23 アメリカ	国債証券	1,366,800,000	96.15 1,314,263,625	96.32 1,316,612,812	0.125 2023/10/15	0.35
27	US T N/B 2.25 02/15/52 アメリカ	国債証券	1,611,457,200	78.58 1,266,441,682	81.52 1,313,715,293	2.25 2052/2/15	0.35
28	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証券	1,366,800,000	95.42 1,304,332,961	95.62 1,307,002,500	0.125 2024/1/15	0.35
29	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証券	1,366,800,000	95.08 1,299,581,199	95.34 1,303,158,375	0.25 2024/3/15	0.34
30	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	1,229,815,400	103.31 1,270,578,491	105.46 1,296,976,848	2.5 2030/5/25	0.34

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	103.93
合計	103.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年6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	274,584	15,510.11 4,258,830,331	16,170.61 4,440,190,995	- -	6.67
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	33,768	88,097.02 2,974,860,300	88,773.65 2,997,708,950	- -	4.51

3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	56,663	41,511.48 2,352,165,004	42,515.68 2,409,066,021	- -	3.62
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	223,245	9,035.78 2,017,193,232	9,480.12 2,116,390,460	- -	3.18
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	168,476	10,854.59 1,828,738,262	11,375.87 1,916,562,152	- -	2.88
6	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	105,646	17,629.72 1,862,509,680	17,413.03 1,839,617,178	- -	2.77
7	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	121,871	13,254.78 1,615,373,889	13,293.49 1,620,091,748	- -	2.44
8	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	357,480	4,092.84 1,463,108,591	4,082.63 1,459,459,144	- -	2.19
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	51,906	26,285.66 1,364,383,686	26,663.53 1,383,997,416	- -	2.08
10	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	127,056	9,770.79 1,241,438,175	9,895.63 1,257,299,419	- -	1.89
11	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	49,863	22,334.36 1,113,658,231	23,365.44 1,165,071,233	- -	1.75
12	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	226,651	4,690.67 1,063,146,199	4,871.27 1,104,079,395	- -	1.66
13	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	55,160	18,301.61 1,009,516,990	19,755.72 1,089,725,912	- -	1.64
14	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	142,778	7,256.51 1,036,071,015	7,565.23 1,080,149,551	- -	1.62
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	148,449	6,699.38 994,516,503	7,047.22 1,046,152,880	- -	1.57
16	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	605,030	1,664.32 1,006,969,334	1,708.97 1,033,984,169	- -	1.55
17	MID AMERICA アメリカ	投資証券	42,872	22,596.21 968,745,094	23,671.60 1,014,849,229	- -	1.53
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	45,170	21,301.27 962,178,558	21,853.76 987,134,574	- -	1.48
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	24,272	35,114.11 852,289,786	35,857.99 870,345,327	- -	1.31
20	LINK REIT 香港	投資証券	751,320	1,124.77 845,069,227	1,132.52 850,885,302	- -	1.28
21	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	71,667	11,512.07 825,036,041	11,474.28 822,327,654	- -	1.24
22	SEGRO PLC イギリス	投資証券	446,846	1,647.86 736,344,057	1,684.44 752,686,236	- -	1.13
23	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	39,590	17,919.57 709,436,031	18,304.18 724,662,707	- -	1.09
24	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	107,994	6,493.60 701,270,565	6,585.24 711,166,667	- -	1.07
25	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	200,558	3,418.03 685,513,585	3,531.81 708,332,990	- -	1.06
26	UDR INC アメリカ	投資証券	111,249	6,077.89 676,159,445	6,326.91 703,863,211	- -	1.06

27	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	53,016	12,327.12 653,535,104	12,302.56 652,232,881	- -	0.98
28	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	229,771	2,629.56 604,196,905	2,758.20 633,754,923	- -	0.95
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	64,318	9,569.18 615,470,644	9,727.51 625,654,348	- -	0.94
30	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	265,815	2,240.64 595,597,776	2,145.87 570,406,028	- -	0.86

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	10.00
投資証券	92.63
合計	102.63

（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

2022年6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	1,643,083	2,577.26 4,234,657,168	2,260.07 3,713,487,525	- -	5.68
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	416,600	6,539.32 2,724,283,870	6,354.65 2,647,347,190	- -	4.05
3	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	1,014,568	1,690.20 1,714,824,627	1,993.44 2,022,485,506	- -	3.09
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	318,493	6,991.14 2,226,631,705	6,101.59 1,943,316,888	- -	2.97

5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	273,400	2,814.92 769,601,225	3,530.74 965,306,503	- -	1.48
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	202,640	4,483.75 908,588,637	4,489.46 909,744,377	- -	1.39
7	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	134,435	4,000.32 537,784,159	4,376.87 588,405,056	- -	0.90
8	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	6,389,530	101.63 649,380,050	90.88 580,681,764	- -	0.89
9	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	223,517	2,993.46 669,089,236	2,546.05 569,086,575	- -	0.87
10	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	266,389	2,414.43 643,178,651	2,076.85 553,251,892	- -	0.85
11	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	115,081	4,113.87 473,428,438	3,788.24 435,954,562	- -	0.67
12	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	827,225	479.63 396,765,955	510.93 422,656,550	- -	0.65
13	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	340,870	1,320.05 449,967,352	1,222.78 416,810,722	- -	0.64
14	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	129,980	3,983.24 517,741,570	3,090.70 401,729,575	- -	0.61
15	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	422,000	981.01 413,987,738	936.65 395,269,676	- -	0.60
16	BAIDU INC ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	149,050	2,581.03 384,702,730	2,611.50 389,244,075	- -	0.60
17	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	145,313	2,724.84 395,955,472	2,492.26 362,158,794	- -	0.55

18	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	36,324	11,337.01 411,805,809	9,888.79 359,200,771	- -	0.55
19	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	61,234	6,324.70 387,286,831	5,725.46 350,593,429	- -	0.54
20	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	138,300	2,665.00 368,569,695	2,527.93 349,612,995	- -	0.53
21	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	54,475	6,292.50 342,784,127	5,617.68 306,023,118	- -	0.47
22	MEDIA TEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	100,507	3,805.55 382,485,171	3,042.58 305,800,889	- -	0.47
23	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	3,747,235	82.40 308,796,861	81.30 304,667,817	- -	0.47
24	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	240,000	1,119.03 268,567,808	1,264.83 303,560,760	- -	0.46
25	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	54,000	4,285.97 231,442,710	5,484.15 296,144,100	- -	0.45
26	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	14,541	13,141.58 191,091,776	19,705.97 286,544,591	- -	0.44
27	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	5,246,200	54.27 284,742,521	54.49 285,882,750	- -	0.44
28	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信 サービス	1,894,478	147.99 280,370,770	138.76 262,893,258	- -	0.40
29	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	87,940	2,698.93 237,344,471	2,987.82 262,749,312	- -	0.40
30	PINDUODUO INC ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	29,368	5,902.99 173,359,108	8,620.40 253,164,130	- -	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年6月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	91.45
投資信託受益証券	0.52
投資証券	0.09
合計	92.06

(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

2022年6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	14.01
半導体・半導体製造装置		8.23
インターネット販売・通信販売		6.66
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.67
コンピュータ・周辺機器		4.57
石油・ガス・消耗燃料		4.49
金属・鉱業		3.57
自動車		3.18
化学		3.10
保険		2.53
電子装置・機器・部品		2.51
情報技術サービス		2.09
不動産管理・開発		1.85
食品		1.79
無線通信サービス		1.57
各種電気通信サービス		1.39
飲料		1.32
医薬品		1.17
食品・生活必需品小売り		1.10
繊維・アパレル・贅沢品		1.03
娯楽		1.02
電力		1.02
コングロマリット		0.96
ホテル・レストラン・レジャー		0.96
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.92
電気設備		0.90
資本市場		0.90
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.88
建設資材		0.76
各種金融サービス		0.72
パーソナル用品		0.70
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.68
貯蓄・抵当・不動産金融		0.67
運送インフラ		0.65
専門小売り		0.64
バイオテクノロジー		0.64
ガス		0.60
消費者金融		0.56
建設・土木		0.51
海運業		0.49

機械	0.45
自動車部品	0.45
家庭用耐久財	0.36
タバコ	0.35
ソフトウェア	0.31
航空貨物・物流サービス	0.28
陸運・鉄道	0.25
複合小売り	0.23
旅客航空輸送業	0.23
ヘルスケア機器・用品	0.19
紙製品・林産品	0.18
航空宇宙・防衛	0.16
商社・流通業	0.15
通信機器	0.15
メディア	0.14
水道	0.11
商業サービス・用品	0.09
家庭用品	0.07
各種消費者サービス	0.07
レジャー用品	0.07
エネルギー設備・サービス	0.06
建設関連製品	0.04
容器・包装	0.03
総合公益事業	0.03
ヘルスケア・テクノロジー	0.00
合計	91.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年6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	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	1,940,856,000	90.50 1,756,532,358	83.36 1,618,067,637	6 2033/2/22	1.44
2	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,913,520,000	87.79 1,679,943,447	84.00 1,607,432,824	2.783 2031/1/23	1.43
3	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48 カタール	国債証券	1,503,480,000	109.43 1,645,264,998	104.63 1,573,091,124	5.103 2048/4/23	1.40
4	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	1,503,480,000	106.74 1,604,912,961	100.94 1,517,755,542	4.817 2049/3/14	1.35
5	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,640,160,000	93.64 1,535,879,994	87.24 1,430,890,329	5.5 2029/2/22	1.27
6	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,503,480,000	96.30 1,447,940,082	93.42 1,404,639,856	4.625 2028/1/13	1.25

7	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,366,800,000	103.38 1,413,103,083	100.90 1,379,206,539	4.375 2031/1/23	1.22
8	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	1,913,520,000	75.03 1,435,867,137	68.67 1,314,024,784	5.875 2060/1/30	1.17
9	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,503,480,000	92.27 1,387,269,196	86.72 1,303,888,519	4.85 2029/9/30	1.16
10	PANAMA 2.252 09/29/32 パナマ	国債証券	1,640,160,000	80.65 1,322,810,908	77.82 1,276,449,386	2.252 2032/9/29	1.13
11	STATE OF QATAR 4.5 04/23/28 カタール	国債証券	1,230,120,000	105.67 1,299,953,912	103.68 1,275,449,922	4.5 2028/4/23	1.13
12	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,230,120,000	102.94 1,266,353,868	100.96 1,241,967,285	4 2029/3/14	1.10
13	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25 サウジアラビア	国債証券	1,230,120,000	101.79 1,252,208,854	100.58 1,237,316,202	4 2025/4/17	1.10
14	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.625 03/04/28 サウジアラビア	国債証券	1,230,120,000	100.61 1,237,637,400	98.42 1,210,684,104	3.625 2028/3/4	1.07
15	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55 ウルグアイ	国債証券	1,230,120,000	102.35 1,259,113,928	98.19 1,207,967,002	4.975 2055/4/20	1.07
16	PANAMA 4.5 04/01/56 パナマ	国債証券	1,503,480,000	86.30 1,297,590,715	79.21 1,190,960,242	4.5 2056/4/1	1.06
17	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	1,230,120,000	99.39 1,222,711,944	95.14 1,170,336,168	4.4 2050/4/16	1.04
18	PHILIPPINES 3.0 02/01/28 フィリピン	国債証券	1,230,120,000	96.63 1,188,711,427	94.83 1,166,534,088	3 2028/2/1	1.04
19	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	1,640,160,000	79.64 1,306,384,706	69.97 1,147,701,960	5.75 2049/9/30	1.02
20	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,366,800,000	88.37 1,207,850,727	83.78 1,145,107,527	3.875 2030/6/12	1.02
21	STATE OF QATAR 3.375 03/14/24 カタール	国債証券	1,093,440,000	100.61 1,100,191,992	99.38 1,086,660,672	3.375 2024/3/14	0.96
22	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	1,093,440,000	101.67 1,111,802,958	99.23 1,085,022,698	3.75 2030/4/16	0.96
23	ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 10/11/27 アラブ首長国連邦	国債証券	1,093,440,000	99.22 1,084,911,168	97.75 1,068,859,468	3.125 2027/10/11	0.95
24	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,093,440,000	98.24 1,074,220,058	96.66 1,056,919,104	2.5 2025/4/16	0.94

25	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,093,440,000	100.07 1,094,253,246	96.35 1,053,530,325	4.5 2029/4/22	0.93
26	PANAMA 4.5 04/16/50 パナマ	国債証券	1,271,124,000	89.46 1,137,208,079	81.28 1,033,175,115	4.5 2050/4/16	0.92
27	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	956,760,000	103.34 988,773,189	102.18 977,663,292	5.75 2023/11/22	0.87
28	PHILIPPINES 3.75 01/14/29 フィリピン	国債証券	984,096,000	99.18 976,039,534	97.47 959,234,162	3.75 2029/1/14	0.85
29	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証券	956,760,000	100.43 960,887,736	99.05 947,670,780	3.4 2025/4/16	0.84
30	COLOMBIA 4.5 03/15/29 コロンビア	国債証券	1,093,440,000	91.79 1,003,678,143	85.51 935,104,136	4.5 2029/3/15	0.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	106.56
合計	106.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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

2022年6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 Sep22	買建	384	9,967,552,332	10,027,938,240	1.39
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep22	買建	394	1,961,855,526	1,966,857,180	0.27
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep22	買建	30	746,307,204	735,343,200	0.10
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep22	買建	55	652,283,444	661,634,459	0.09
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep22	買建	20	305,952,022	309,682,200	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

2022年6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 Sep22	買建	739	5,083,177,721	5,087,698,412	7.78

（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（2022年6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
第11計算期間末 (2022年6月13日)	6,748	6,748	1.0025	1.0025
2021年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	-
2022年1月末日	8,046	-	1.1475	-
2月末日	7,807	-	1.1209	-
3月末日	7,633	-	1.1045	-
4月末日	7,159	-	1.0519	-
5月末日	7,022	-	1.0398	-
6月末日	6,626	-	0.9890	-

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

直近日(2022年6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
第11計算期間末 (2022年6月13日)	22,061	22,061	1.0041	1.0041
2021年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	-
2022年1月末日	24,642	-	1.0642	-
2月末日	23,975	-	1.0469	-
3月末日	23,537	-	1.0390	-
4月末日	22,855	-	1.0203	-
5月末日	22,401	-	1.0139	-
6月末日	21,864	-	0.9993	-

【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
第11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
第11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
第11計算期間	15.7

（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
第11計算期間	8.6

（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
第11計算期間	48,454,636	537,462,741

(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
第11計算期間	36,964,114	1,793,363,306

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

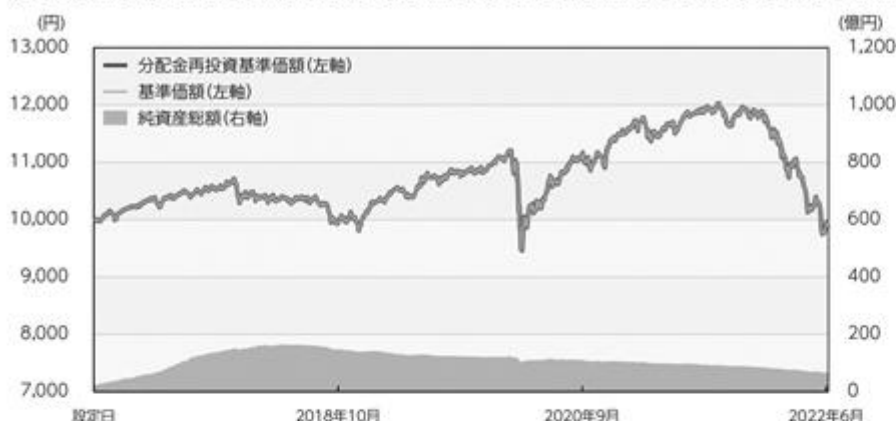
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2022年6月30日

(基本コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2022年6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)

2020年 6月	0円
2020年12月	0円
2021年 6月	0円
2021年12月	0円
2022年 6月	0円
設定来累計	0円

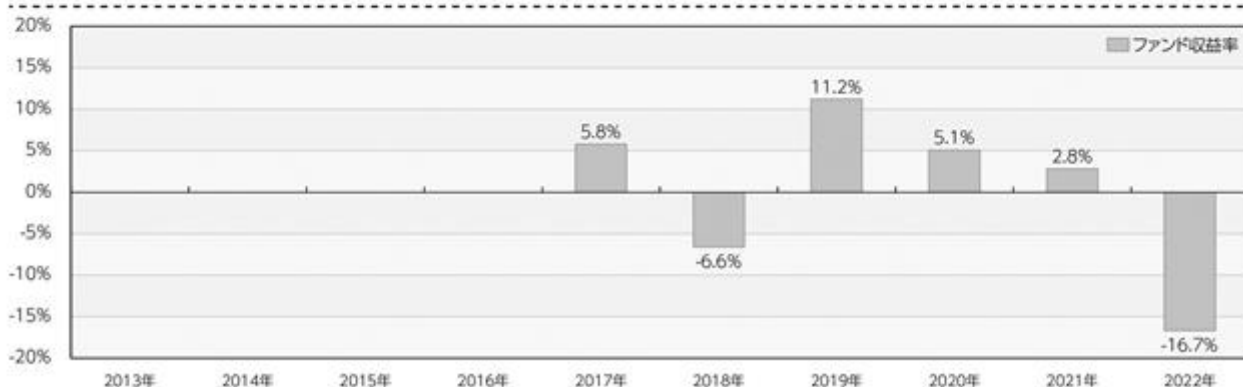
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	43.93
2	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	15.22
3	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	14.89
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.85
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	9.20
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.62

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、および2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

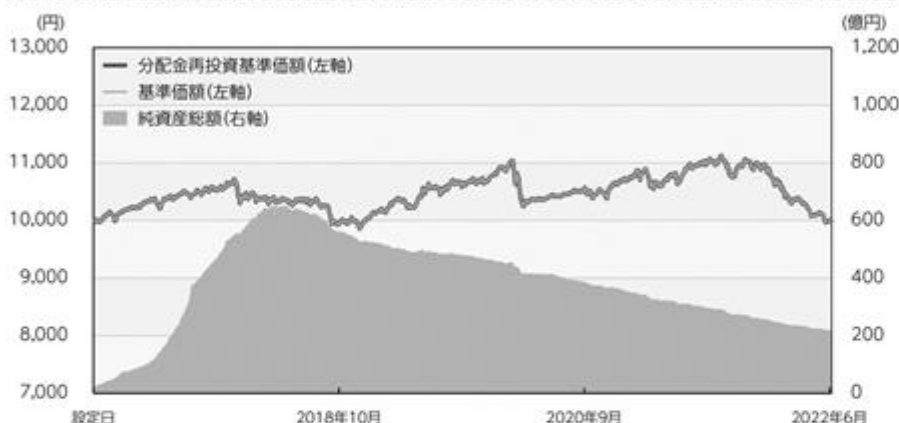
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2022年6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～2022年6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)

2020年 6月	0円
2020年12月	0円
2021年 6月	0円
2021年12月	0円
2022年 6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	1059回 国庫短期証券	国債証券	日本	22.89
2	1074回 国庫短期証券	国債証券	日本	11.45
3	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	8.54
4	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	2.94
5	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	2.87
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2.72
7	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	1.91
8	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.29

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、および2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2022年6月30日

主要な資産の状況

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.79
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.91
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.10
4	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.42
5	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.34

■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 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.55
2	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.48
3	FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	フランス	0.5	2029/5/25	0.47
4	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.46
5	US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	アメリカ	1.875	2032/2/15	0.45

■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	6.67
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.51
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.62
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.18
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.88

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	5.68
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	4.05
3	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	3.09
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	2.97
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.48

○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:2022年6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	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国債証券	ドミニカ共和国	6	2033/2/22	1.44
2	PERU 2.783 01/23/31	国債証券	ペルー	2.783	2031/1/23	1.43
3	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	国債証券	カタール	5.103	2048/4/23	1.40
4	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.35
5	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	1.27

○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たと
きは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

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

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

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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11期計算期間(2021年12月14日から2022年6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10期 2021年12月13日現在	第11期 2022年6月13日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,782,198	4,878,254
コール・ローン	173,820,751	223,934,944
投資信託受益証券	40,835,279	41,580,189
親投資信託受益証券	8,454,626,749	6,595,966,384
派生商品評価勘定	160,457	-
未収入金	-	100,000,000
流動資産合計	8,673,225,434	6,966,359,771
資産合計	8,673,225,434	6,966,359,771
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,942,516	163,798,213
未払金	-	1,970,134
未払解約金	12,555,980	4,833,412
未払受託者報酬	1,523,800	1,261,949
未払委託者報酬	55,874,389	46,273,100
その他未払費用	180,744	149,663
流動負債合計	84,077,429	218,286,471
負債合計	84,077,429	218,286,471
純資産の部		
元本等		
元本	7,219,970,883	6,730,962,778
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,369,177,122	17,110,522
（分配準備積立金）	1,078,854,044	1,036,018,464
元本等合計	8,589,148,005	6,748,073,300
純資産合計	8,589,148,005	6,748,073,300
負債純資産合計	8,673,225,434	6,966,359,771

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期 自 2021年6月12日 至 2021年12月13日	第11期 自 2021年12月14日 至 2022年6月13日
営業収益		
受取配当金	316,109	381,090
受取利息	274	1,174
有価証券売買等損益	220,139,873	538,325,110
為替差損益	141,718,396	705,408,120
営業収益合計	78,737,860	1,243,350,966
営業費用		
支払利息	22,621	13,545
受託者報酬	1,523,800	1,261,949
委託者報酬	55,874,389	46,273,100
その他費用	1,156,872	1,161,874
営業費用合計	58,577,682	48,710,468
営業利益又は営業損失()	20,160,178	1,292,061,434
経常利益又は経常損失()	20,160,178	1,292,061,434
当期純利益又は当期純損失()	20,160,178	1,292,061,434
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()	311,539	35,657,663
期首剰余金又は期首欠損金()	1,528,451,000	1,369,177,122
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,710,623	6,201,616
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	29,710,623	6,201,616
剰余金減少額又は欠損金増加額	208,833,140	101,864,445
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	208,833,140	101,864,445
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()	1,369,177,122	17,110,522

(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11期	
	自 2021年12月14日	至 2022年6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礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <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、前計算期間末日を2021年12月13日、当計算期間末日を2022年6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10期	第11期
	2021年12月13日現在	2022年6月13日現在
1. 期首元本額	8,177,759,568円	7,219,970,883円
期中追加設定元本額	159,562,024円	48,454,636円
期中一部解約元本額	1,117,350,709円	537,462,741円
2. 受益権の総数	7,219,970,883口	6,730,962,778口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期	第11期
	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日	自 2021年12月14日 至 2022年6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(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)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(37,184,797円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(234,475,225円)及び分配準備積立金(998,833,667円)より分配対象収益は1,270,493,689円(1万口当たり1,887.53円)ですが、分配を行っておりません。
-------------	--	--

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 自 2021年6月12日 至 2021年12月13日	第11期 自 2021年12月14日 至 2022年6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。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 2021年12月13日現在	第11期 2022年6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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 2021年12月13日現在	第11期 2022年6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	3,558,380	6,964,745
親投資信託受益証券	191,507,662	517,506,905
合計	187,949,282	524,471,650

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

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

種類	第11期			
	2022年6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	3,690,640,633	-	3,854,438,846	163,798,213
アメリカ・ドル	3,007,478,528	-	3,150,236,160	142,757,632
イギリス・ポンド	82,795,236	-	84,420,300	1,625,064
イスラエル・シェケル	1,941,270	-	1,989,650	48,380
オーストラリア・ドル	66,709,584	-	68,068,800	1,359,216
カナダ・ドル	52,933,920	-	54,771,600	1,837,680
シンガポール・ドル	24,427,468	-	25,203,880	776,412
スイス・フラン	30,911,310	-	31,377,060	465,750
スウェーデン・クローナ	10,432,424	-	10,601,800	169,376
デンマーク・クローネ	7,995,721	-	8,182,040	186,319
ニュージーランド・ドル	2,519,349	-	2,561,700	42,351
ノルウェー・クローネ	2,196,848	-	2,209,920	13,072
メキシコ・ペソ	21,207,930	-	21,804,836	596,906
ユーロ	125,893,040	-	128,783,200	2,890,160
香港・ドル	218,412,600	-	228,653,600	10,241,000
南アフリカ・ランド	34,785,405	-	35,574,300	788,895
合計	3,690,640,633	-	3,854,438,846	163,798,213

(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10期 2021年12月13日現在	第11期 2022年6月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1896円 (11,896円)	1.0025円 (10,025円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年6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	308,001.400	
	アメリカ・ドル	小計	13,300.000	308,001.400 (41,580,189)	
投資信託受益証券 合計			13,300	41,580,189 (41,580,189)	
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	170,860,090	1,003,290,448	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	355,965,633	610,089,498	
		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	2,318,936,250	2,931,599,207	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	699,724,095	1,021,807,095	
	日本円	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	511,368,447	1,029,180,136	
日本円 小計			4,056,854,515	6,595,966,384	
親投資信託受益証券 合計			4,056,854,515	6,595,966,384	
合計				6,637,546,573	

(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	0.62	0.63

(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10期 2021年12月13日現在	第11期 2022年6月13日現在
資産の部		
流動資産		
預金	5,490,318	7,115,575
コール・ローン	2,683,660,809	9,257,645,623
国債証券	-	7,505,525,000
投資信託受益証券	62,941,595	64,089,765
親投資信託受益証券	23,601,128,788	5,529,654,657
派生商品評価勘定	468,560	-
流動資産合計	26,353,690,070	22,364,030,620
資産合計	26,353,690,070	22,364,030,620
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	39,143,965	137,739,119
未払解約金	73,427,720	16,497,366
未払受託者報酬	4,762,152	3,929,566
未払委託者報酬	174,613,780	144,084,954
その他未払費用	480,945	428,332
流動負債合計	292,428,562	302,679,337
負債合計	292,428,562	302,679,337
純資産の部		
元本等		
元本	23,728,055,303	21,971,656,111
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,333,206,205	89,695,172
(分配準備積立金)	1,545,058,727	1,428,388,805
元本等合計	26,061,261,508	22,061,351,283
純資産合計	26,061,261,508	22,061,351,283
負債純資産合計	26,353,690,070	22,364,030,620

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期 自 2021年6月12日 至 2021年12月13日	第11期 自 2021年12月14日 至 2022年6月13日
営業収益		
受取配当金	487,235	587,394
受取利息	652	12,719
有価証券売買等損益	645,621,548	1,167,379,264
為替差損益	437,334,312	840,989,739
営業収益合計	208,775,123	2,007,768,890
営業費用		
支払利息	61,052	607,633
受託者報酬	4,762,152	3,929,566
委託者報酬	174,613,780	144,084,954
その他費用	1,546,558	1,891,990
営業費用合計	180,983,542	150,514,143
営業利益又は営業損失()	27,791,581	2,158,283,033
経常利益又は経常損失()	27,791,581	2,158,283,033
当期純利益又は当期純損失()	27,791,581	2,158,283,033
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,351,237	88,986,117
期首剰余金又は期首欠損金()	2,738,761,389	2,333,206,205
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,975,804	2,082,906
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	8,975,804	2,082,906
剰余金減少額又は欠損金増加額	443,673,806	176,297,023
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	443,673,806	176,297,023
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()	2,333,206,205	89,695,172

(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11期	
	自 2021年12月14日	至 2022年6月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <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>親投資信託受益証券</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、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</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礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い</p> <p>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、前計算期間末日を2021年12月13日、当計算期間末日を2022年6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10期	第11期
	2021年12月13日現在	2022年6月13日現在
1. 期首元本額	28,204,299,614円	23,728,055,303円
期中追加設定元本額	92,831,691円	36,964,114円
期中一部解約元本額	4,569,076,002円	1,793,363,306円
2. 受益権の総数	23,728,055,303口	21,971,656,111口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期	第11期
	自 2021年6月12日 至 2021年12月13日	自 2021年12月14日 至 2022年6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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(628,335,130円)及び分配準備積立金(1,428,388,805円)より分配対象収益は2,056,723,935円(1万口当たり936.08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10期 自 2021年6月12日 至 2021年12月13日	第11期 自 2021年12月14日 至 2022年6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。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 2021年12月13日現在	第11期 2022年6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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 2021年12月13日現在	第11期 2022年6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)
国債証券	-	470,000
投資信託受益証券	5,484,721	10,735,133
親投資信託受益証券	516,654,769	438,672,449
合計	511,170,048	449,877,582

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

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	12,845,133,863	-	12,883,809,268	38,675,405
アメリカ・ドル	10,475,797,320	-	10,507,320,810	31,523,490
イギリス・ポンド	283,171,240	-	282,963,688	207,552
イスラエル・シェケル	6,493,680	-	6,589,944	96,264
オーストラリア・ドル	225,410,238	-	227,025,927	1,615,689
カナダ・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

種類	第11期			
	2022年6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	3,099,750,573	-	3,237,489,692	137,739,119
アメリカ・ドル	2,537,560,008	-	2,658,011,760	120,451,752
イギリス・ポンド	68,184,312	-	69,522,600	1,338,288
イスラエル・シェケル	1,553,016	-	1,591,720	38,704
オーストラリア・ドル	55,591,320	-	56,724,000	1,132,680
カナダ・ドル	43,772,280	-	45,291,900	1,519,620
シンガポール・ドル	20,669,396	-	21,326,360	656,964
スイス・フラン	25,535,430	-	25,920,180	384,750
スウェーデン・クローナ	8,583,640	-	8,723,000	139,360
デンマーク・クローネ	6,508,145	-	6,659,800	151,655
ニュージーランド・ドル	2,519,349	-	2,561,700	42,351
ノルウェー・クローネ	1,922,242	-	1,933,680	11,438
メキシコ・ペソ	17,044,410	-	17,524,132	479,722
ユーロ	103,758,000	-	106,140,000	2,382,000
香港・ドル	178,671,360	-	187,048,960	8,377,600
南アフリカ・ランド	27,877,665	-	28,509,900	632,235
合計	3,099,750,573	-	3,237,489,692	137,739,119

(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10期 2021年12月13日現在	第11期 2022年6月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0983円 (10,983円)	1.0041円 (10,041円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年6月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	1059回 国庫短期証券	5,000,000,000	5,003,400,000	
		1074回 国庫短期証券	2,500,000,000	2,502,125,000	
	日本円 小計		7,500,000,000	7,505,525,000	
国債証券 合計			7,500,000,000	7,505,525,000	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	20,500.000	474,739.000	
	アメリカ・ドル 小計		20,500.000	474,739.000 (64,089,765)	
投資信託受益証券 合計			20,500	64,089,765 (64,089,765)	
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	141,556,845	831,221,793	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	296,124,910	507,528,483	
		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	1,961,294,681	2,479,468,735	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	571,570,865	834,664,934	

	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	435,640,819	876,770,712	
	日本円 小計	3,406,188,120	5,529,654,657	
親投資信託受益証券 合計		3,406,188,120	5,529,654,657	
合計			13,099,269,422 (64,089,765)	

(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	0.29	0.49

(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)

2022年6月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	12,632,106,024
コール・ローン	282,378,811
株式	690,561,894,067
投資信託受益証券	1,268,193,514
投資証券	16,031,673,870
派生商品評価勘定	1,805,095
未収入金	6,802,615
未収配当金	1,017,155,616
差入委託証拠金	4,205,247,866
流動資産合計	726,007,257,478
資産合計	
726,007,257,478	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	613,120,038
未払金	75,639,903
未払解約金	385,853,000
流動負債合計	1,074,612,941
負債合計	
1,074,612,941	
純資産の部	
元本等	
元本	123,455,090,340
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	601,477,554,197
元本等合計	724,932,644,537
純資産合計	
724,932,644,537	
負債純資産合計	
726,007,257,478	

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12月14日 至 2022年6月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年6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	113,388,316,058円
同期中追加設定元本額	50,980,861,706円
同期中一部解約元本額	40,914,087,424円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,318,120,747円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,425,622円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	15,702,654円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	82,455,558円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,017,999円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	11,198,670円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	18,553,202円
たわらノーロード 先進国株式	33,047,854,320円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	310,390,012円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,658,937,672円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	663,835,796円
たわらノーロード バランス(堅実型)	72,247,086円
たわらノーロード バランス(標準型)	602,594,219円
たわらノーロード バランス(積極型)	746,274,354円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	1,025,842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)	143,943,839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)	446,935,789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)	343,539,774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)	504,516,145円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,308,954円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	22,016,669円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,484,782円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,369,730円
たわらノーロード 全世界株式	308,615,135円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	53,163,048,617円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,469,720,146円
Oneグローバルバランス	2,792,233円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	156,189,678円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	788,557,983円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,017,255,475円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	93,732,050円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	258,725,058円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	243,967,024円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,659,398円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	608,063,735円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	123,370,292円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	166,900,378円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	172,017,795円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	307,177,146円
投資のソムリエ	4,929,432,981円
クルーズコントロール	78,988,807円
投資のソムリエ<DC年金>	308,230,068円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	184,358,844円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	175,238,312円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	259,630,501円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,329,063,521円
ワールドアセットバランス(基本コース)	170,860,090円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	141,556,845円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	26,909,958円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	13,589,464円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,727,241円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	38,267,079円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	112,977,273円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	236,162,452円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	143,771,732円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	20,279,191円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	13,579,492円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,984,247円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	49,726,523円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,569,984円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,080,114円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,203,616円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	7,002,168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)	719,029円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,054,128円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	126,341円
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)	10,176,730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)	961,920円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	14,247,789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)	392,021,658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)	62,492,223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)	1,173,530,915円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,609,302円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,051,462,765円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	127,557,889円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	2,324,385円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	7,708,235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)	1,911,209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)	5,179,456円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	22,851,285円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	27,564,059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)	52,318,249円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,244,043円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	21,381,173円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,474,383円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	237,265円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,737,406円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	23,815,995円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	183,965,802円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	283,134,019円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	934,865,308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)	63,743,538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)	42,452,786円

D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	293,917,765円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	12,003,014円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,501,857円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	115,251,238円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	10,539,056円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	36,555,159円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	55,943,109円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	118,147,729円
動的パッケージファンド<DC年金>	6,565,157円
コア資産形成ファンド	4,412,486円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	4,117,780,273円
MHAM外国株式インデックスファンド	138,233,003円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	14,485,203円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	909,450,355円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,698,702,123円
計	123,455,090,340円
2. 受益権の総数	123,455,090,340口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月14日 至 2022年6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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	78,688,991,891	
投資信託受益証券	124,917,744	
投資証券	1,375,315,739	
合計	80,189,225,374	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年2月16日から2022年6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	2022年6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					
アメリカ・ドル	379,799,028	-	380,540,570	741,542	
イギリス・ポンド	298,675,880	-	299,952,996	1,277,116	
オーストラリア・ドル	13,916,527	-	13,751,713	164,814	
カナダ・ドル	5,804,821	-	5,771,618	33,203	
ユーロ	20,067,230	-	20,034,550	32,680	
ユーロ	41,334,570	-	41,029,693	304,877	
買建	90,236,994	-	89,941,516	295,478	
イギリス・ポンド	2,982,132	-	2,982,180	48	
オーストラリア・ドル	26,126,295	-	25,829,947	296,348	
カナダ・ドル	15,288,075	-	15,288,800	725	
ユーロ	45,840,492	-	45,840,589	97	
合計	470,036,022	-	470,482,086	1,037,020	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年6月13日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	17,551,091,238	-	16,940,813,315	610,277,923
合計	17,551,091,238	-	16,940,813,315	610,277,923

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年6月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.8720円 (58,720円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年6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	1,007,360	109.650	110,457,024.000	
	ABBOTT LABORATORIES	194,254	109.630	21,296,066.020	
	AES CORP	69,518	20.690	1,438,327.420	
	ABIOMED INC	4,472	250.430	1,119,922.960	

INTL BUSINESS MACHINES CORP	99,122	136.190	13,499,425.180	
ADVANCED MICRO DEVICES	180,388	94.820	17,104,390.160	
ADOBE INC	52,062	393.840	20,504,098.080	
CHUBB LTD	46,916	201.660	9,461,080.560	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	23,706	248.200	5,883,829.200	
ALLEGHANY CORP	1,594	834.110	1,329,571.340	
ALLSTATE CORP	29,578	124.590	3,685,123.020	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	75,503	186.280	14,064,698.840	
AMGEN INC	61,449	240.010	14,748,374.490	
HESS CORP	29,886	127.720	3,817,039.920	
AMERICAN EXPRESS CO	69,927	154.420	10,798,127.340	
AMERICAN ELECTRIC POWER	54,294	98.260	5,334,928.440	
AFLAC INC	65,217	55.630	3,628,021.710	
AMERICAN INTL GROUP	91,441	53.430	4,885,692.630	
AMERCO	980	474.210	464,725.800	
ANALOG DEVICES	56,984	156.920	8,941,929.280	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	75,557	51.920	3,922,919.440	
VALERO ENERGY CORP	45,590	140.510	6,405,850.900	
ANSYS INC	9,857	241.870	2,384,112.590	
APPLE INC	1,793,979	137.130	246,008,340.270	
APPLIED MATERIALS INC	97,410	101.880	9,924,130.800	
ALBEMARLE CORP	13,133	236.870	3,110,813.710	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	60,226	84.680	5,099,937.680	
AMEREN CORP	28,729	89.240	2,563,775.960	
ARROW ELECTRONICS INC	6,673	119.270	795,888.710	
AUTODESK INC	23,598	187.080	4,414,713.840	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	46,370	211.620	9,812,819.400	
AUTOZONE INC	2,316	2,064.460	4,781,289.360	
AVERY DENNISON CORP	8,463	168.890	1,429,316.070	
BALL CORP	36,411	68.480	2,493,425.280	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	141,905	291.710	41,395,107.550	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,892	42.790	3,632,528.680	
BAXTER INTERNATIONAL INC	54,179	73.120	3,961,568.480	
BECTON DICKINSON & CO	30,627	249.330	7,636,229.910	
AMETEK INC	24,982	115.460	2,884,421.720	
VERIZON COMM INC	462,411	50.820	23,499,727.020	
WR BERKLEY CORP	24,066	68.260	1,642,745.160	
BEST BUY CO INC	22,198	72.600	1,611,574.800	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	506.320	1,245,040.880	
YUM! BRANDS INC	30,146	114.410	3,449,003.860	

FIRSTENERGY CORP	61,472	40.600	2,495,763.200	
BOEING CO	61,694	127.000	7,835,138.000	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	84.600	1,006,486.200	
BORGWARNER INC	27,800	37.500	1,042,500.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	153,540	37.230	5,716,294.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,979	101.730	1,320,353.670	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	17,656	127.950	2,259,085.200	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,588	1,200.440	3,106,738.720	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	240,248	75.090	18,040,222.320	
ONEOK INC	48,247	64.740	3,123,510.780	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	135.140	1,066,389.740	
UNITED RENTALS INC	8,343	280.220	2,337,875.460	
SEMPRA ENERGY	35,221	154.660	5,447,279.860	
FEDEX CORP	26,978	206.770	5,578,241.060	
VERISIGN INC	10,834	169.100	1,832,029.400	
AMPHENOL CORP	63,997	67.550	4,322,997.350	
BROWN-FORMAN CORP	35,058	68.450	2,399,720.100	
QUANTA SERVICES INC	15,516	126.600	1,964,325.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	6.100	620,766.500	
CSX CORP	236,820	30.300	7,175,646.000	
COTERRA ENERGY INC	91,495	34.310	3,139,193.450	
CAMPBELL SOUP CO	21,404	46.930	1,004,489.720	
CONSTELLATION BRANDS INC	18,254	239.090	4,364,348.860	
CARDINAL HEALTH INC	31,857	53.460	1,703,075.220	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	102,945	11.050	1,137,542.250	
CATERPILLAR INC	59,180	215.180	12,734,352.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	123.790	1,342,502.550	
CITRIX SYSTEMS INC	14,230	97.940	1,393,686.200	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	11.270	1,094,012.710	
JPMORGAN CHASE & CO	325,130	119.550	38,869,291.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	25,740	85.900	2,211,066.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,424	119.900	1,849,337.600	
CINTAS CORP	10,142	374.760	3,800,815.920	
CISCO SYSTEMS INC	458,339	43.490	19,933,163.110	
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	19.640	1,106,988.960	
CLOROX COMPANY	14,322	131.100	1,877,614.200	
COCA-COLA CO/THE	453,116	61.410	27,825,853.560	
COPART INC	23,125	108.300	2,504,437.500	
COGNEX CORP	20,432	45.180	923,117.760	
COLGATE-PALMOLIVE CO	85,855	76.630	6,579,068.650	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	31,127	159.870	4,976,273.490	

MOLINA HEALTHCARE INC	5,926	276.410	1,638,005.660	
NRG ENERGY, INC.	23,951	44.010	1,054,083.510	
COMCAST CORP-CL A	497,564	41.630	20,713,589.320	
CONAGRA BRANDS INC	56,415	32.570	1,837,436.550	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,375	95.150	3,651,381.250	
CMS ENERGY CORP	33,771	67.710	2,286,634.410	
COOPER COS INC	5,811	332.350	1,931,285.850	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	52.340	1,113,847.540	
CORNING INC	88,055	33.280	2,930,470.400	
SEALED AIR CORP	17,610	59.920	1,055,191.200	
HEICO CORP-CL A	7,767	114.720	891,030.240	
CUMMINS INC	16,021	205.500	3,292,315.500	
DR HORTON INC	36,330	70.390	2,557,268.700	
DANAHER CORP	75,015	251.480	18,864,772.200	
MOODY'S CORP	17,912	273.230	4,894,095.760	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	56,177	69.910	3,927,334.070	
TARGET CORP	53,271	149.670	7,973,070.570	
DEERE & CO	32,195	335.230	10,792,729.850	
MORGAN STANLEY	147,433	77.400	11,411,314.200	
REPUBLIC SERVICES INC	25,597	126.540	3,239,044.380	
COSTAR GROUP INC	42,672	58.590	2,500,152.480	
THE WALT DISNEY CO	200,660	99.400	19,945,604.000	
DOLLAR TREE INC	24,238	156.000	3,781,128.000	
DOVER CORP	16,595	128.410	2,130,963.950	
OMNICOM GROUP	20,880	67.990	1,419,631.200	
DTE ENERGY CO	22,180	127.500	2,827,950.000	
DUKE ENERGY CORP	84,877	107.770	9,147,194.290	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	119.940	1,671,843.660	
EBAY INC	62,911	44.280	2,785,699.080	
BANK OF AMERICA CORP	800,384	33.170	26,548,737.280	
CITIGROUP INC	220,094	47.710	10,500,684.740	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	102.190	1,442,003.090	
EATON CORP PLC	43,135	137.030	5,910,789.050	
CADENCE DESIGN SYS INC	30,055	149.110	4,481,501.050	
DISH NETWORK CORP	24,416	20.080	490,273.280	
ECOLAB INC	27,915	158.740	4,431,227.100	
PERKINELMER INC	13,622	141.900	1,932,961.800	
ELECTRONIC ARTS INC	31,306	133.440	4,177,472.640	
SALESFORCE INC	108,829	178.450	19,420,535.050	
ERIE INDEMNITY CO	2,431	174.820	424,987.420	
EMERSON ELECTRIC CO	63,595	87.060	5,536,580.700	
ATMOS ENERGY CORP	15,146	111.970	1,695,897.620	
ENTERGY CORP	22,173	115.930	2,570,515.890	
EOG RESOURCES INC	64,894	144.000	9,344,736.000	
EQUIFAX INC	13,970	183.350	2,561,399.500	
EQT CORP	36,492	47.960	1,750,156.320	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	24,949	249.480	6,224,276.520	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,678	98.460	1,937,495.880	

EXXON MOBIL CORP	465,781	100.460	46,792,359.260	
FMC CORP	12,931	112.700	1,457,323.700	
NEXTERA ENERGY INC	216,768	75.910	16,454,858.880	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,101	362.940	1,488,416.940	
FAIR ISAAC CORP	2,962	401.810	1,190,161.220	
ASSURANT INC	5,823	173.900	1,012,619.700	
FASTENAL CO	61,876	51.980	3,216,314.480	
FIFTH THIRD BANCORP	77,885	35.680	2,778,936.800	
M&T BANK CORP	19,455	165.840	3,226,417.200	
FISERV INC	68,807	94.340	6,491,252.380	
FORD MOTOR CO	419,292	12.750	5,345,973.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	29,162	24.560	716,218.720	
FREEMONT-MCMORAN INC	161,845	40.210	6,507,787.450	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	640.940	813,993.800	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23,341	153.000	3,571,173.000	
DENTSPLY SIRONA INC	21,462	38.220	820,277.640	
GENERAL DYNAMICS CORP	25,270	224.630	5,676,400.100	
GENERAL MILLS INC	65,734	68.380	4,494,890.920	
GENUINE PARTS CO	16,139	135.930	2,193,774.270	
GILEAD SCIENCES INC	139,121	60.740	8,450,209.540	
GARTNER INC	9,036	247.640	2,237,675.040	
MCKESSON CORP	16,468	313.340	5,160,083.120	
NVIDIA CORP	275,195	169.740	46,711,599.300	
GENERAL ELECTRIC CO	121,961	71.230	8,687,282.030	
WW GRAINGER INC	4,926	488.740	2,407,533.240	
HALLIBURTON CO	95,448	40.490	3,864,689.520	
MONSTER BEVERAGE CORP	44,230	87.040	3,849,779.200	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	37,307	287.020	10,707,855.140	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,482	240.430	5,164,917.260	
HASBRO INC	15,437	84.920	1,310,910.040	
HENRY SCHEIN INC	15,048	81.430	1,225,358.640	
HEICO CORP	5,185	140.840	730,255.400	
HERSHEY FOODS CORP	16,042	213.350	3,422,560.700	
HP INC	112,494	35.280	3,968,788.320	
F5 INC	6,924	156.650	1,084,644.600	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,766	99.170	1,266,004.220	
JUNIPER NETWORKS INC	34,097	28.810	982,334.570	
HOLOGIC INC	25,622	71.730	1,837,866.060	
HOME DEPOT INC	115,000	289.240	33,262,600.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,012	75.080	1,502,500.960	
HORMEL FOODS CORP	30,733	45.840	1,408,800.720	
CENTERPOINT ENERGY INC	72,637	30.120	2,187,826.440	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	201.400	725,442.800	
HUMANA INC	14,049	444.190	6,240,425.310	

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	163.730	1,501,567.830	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	166,279	12.450	2,070,173.550	
BIOGEN INC	15,819	197.500	3,124,252.500	
IDEX CORP	7,766	185.280	1,438,884.480	
ILLINOIS TOOL WORKS	33,503	196.770	6,592,385.310	
INTUIT INC	29,821	381.220	11,368,361.620	
IDEXX LABORATORIES INC	9,143	345.885	3,162,426.550	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,475	130.210	3,447,309.750	
INTEL CORP	448,259	39.180	17,562,787.620	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	27,577	124.900	3,444,367.300	
INTERNATIONAL PAPER CO	37,464	45.000	1,685,880.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	28.950	1,322,407.050	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,561	129.020	1,878,660.220	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	180.450	1,471,028.400	
INCYTE CORP	19,005	70.400	1,337,952.000	
JOHNSON & JOHNSON	288,881	172.550	49,846,416.550	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,131	68.280	2,398,744.680	
KLA CORPORATION	16,280	333.660	5,431,984.800	
DEVON ENERGY CORP	70,299	74.060	5,206,343.940	
KELLOGG CO	29,514	69.580	2,053,584.120	
KEYCORP	94,036	17.770	1,671,019.720	
KIMBERLY-CLARK CORP	36,335	127.760	4,642,159.600	
BLACKROCK INC/NEW YORK	16,793	617.670	10,372,532.310	
KROGER CO	77,870	51.090	3,978,378.300	
LAM RESEARCH CORP	15,442	474.410	7,325,839.220	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,380	380.580	2,047,520.400	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	151.500	1,670,893.500	
AKAMA I TECHNOLOGIES	17,689	97.440	1,723,616.160	
PLUG POWER INC	56,149	15.960	896,138.040	
LENNAR CORP	27,333	74.450	2,034,941.850	
ELI LILLY & CO	89,123	297.010	26,470,422.230	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	33.880	953,925.280	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	51.120	916,939.440	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	80,867	173.050	13,994,034.350	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,324	120.570	3,897,304.680	
LOCKHEED MARTIN CORP	26,979	430.190	11,606,096.010	
LOEWS CORP	23,530	60.340	1,419,800.200	
LOWE'S COS INC	73,967	186.330	13,782,271.110	
DOMINION ENERGY INC	87,075	79.310	6,905,918.250	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	31.780	1,283,943.780	
MCCORMICK & CO INC	27,278	87.980	2,399,918.440	
MCDONALD'S CORPORATION	81,681	237.380	19,389,435.780	
S&P GLOBAL INC	39,098	332.760	13,010,250.480	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	278.100	1,238,657.400	
MARKEL CORPORATION	1,512	1,330.890	2,012,305.680	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	67,390	93.000	6,267,270.000	
MARSH & MCLENNAN COS	55,534	150.040	8,332,321.360	
MASCO CORP	24,668	54.720	1,349,832.960	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,058	321.750	2,270,911.500	
METLIFE INC	76,607	63.470	4,862,246.290	
MEDTRONIC PLC	148,103	92.740	13,735,072.220	
ACTIVISION BLIZZARD INC	83,428	76.480	6,380,573.440	
CVS HEALTH CORP	144,842	93.170	13,494,929.140	
MERCK & CO. INC.	278,188	87.180	24,252,429.840	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	46,268	60.140	2,782,557.520	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,821	224.570	2,205,501.970	
MICROSOFT CORP	783,067	252.990	198,108,120.330	
MICRON TECH INC	123,700	62.620	7,746,094.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	59,471	64.150	3,815,064.650	
3M CO	63,124	137.650	8,689,018.600	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	131.900	832,420.900	
ENTEGRIS INC	14,422	103.900	1,498,445.800	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	219.500	1,224,371.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,823	209.250	3,938,712.750	
ILLUMINA INC	16,859	204.190	3,442,439.210	
XCEL ENERGY INC	58,494	71.010	4,153,658.940	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	94.310	948,852.910	
NETAPP INC	24,953	66.810	1,667,109.930	
NEWELL BRANDS INC	41,984	19.140	803,573.760	
NEWMONT CORP	86,585	66.850	5,788,207.250	
NVR INC	327	4,173.590	1,364,763.930	
NIKE INC-CL B	140,915	114.730	16,167,177.950	
NORDSON CORP	5,664	207.640	1,176,072.960	
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,070	229.360	5,979,415.200	
EVERSOURCE ENERGY	37,606	88.030	3,310,456.180	
NISOURCE INC	44,573	30.050	1,339,418.650	
NORTHERN TRUST CORP	22,556	101.430	2,287,855.080	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,379	463.820	7,596,907.780	
WELLS FARGO & CO	420,571	40.080	16,856,485.680	
NUCOR CORP	29,413	120.170	3,534,560.210	
CHENIERE ENERGY INC	24,273	135.440	3,287,535.120	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,524	112.580	5,237,671.920	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	103,365	63.870	6,601,922.550	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,180	247.180	2,763,472.400	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,296	607.440	4,431,882.240	
ORACLE CORP	176,695	67.140	11,863,302.300	
PACCAR INC	38,135	85.100	3,245,288.500	
PTC INC	11,726	109.090	1,279,189.340	
EXELON CORP	105,216	46.010	4,840,988.160	
PARKER HANNIFIN CORP	13,839	263.610	3,648,098.790	
PAYCHEX INC	34,984	120.630	4,220,119.920	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	257.055	2,209,644.780	
PPL CORPORATION	77,299	28.330	2,189,880.670	
PEPSICO INC	152,087	162.520	24,717,179.240	
PENTAIR PLC	17,214	47.870	824,034.180	
PFIZER INC	619,159	49.970	30,939,375.230	
ESSENTIAL UTILITIES INC	29,234	45.620	1,333,655.080	
CONOCOPHILLIPS	143,576	116.830	16,773,984.080	
PG&E CORP	161,265	10.980	1,770,689.700	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	24,697	270.870	6,689,676.390	
ALTRIA GROUP INC	200,630	48.940	9,818,832.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	46,237	158.330	7,320,704.210	
BROWN & BROWN INC	27,138	55.750	1,512,943.500	
GARMIN LTD	17,835	99.930	1,782,251.550	
PPG INDUSTRIES INC	26,678	115.900	3,091,980.200	
COSTCO WHOLESALE CORP	48,869	463.310	22,641,496.390	
T ROWE PRICE GROUP INC	25,937	114.850	2,978,864.450	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	131.250	1,712,550.000	
PROCTER & GAMBLE CO	263,857	141.950	37,454,501.150	
PROGRESSIVE CORP	64,544	113.560	7,329,616.640	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56,485	65.470	3,698,072.950	
PULTE GROUP INC	30,072	42.000	1,263,024.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	31,571	117.440	3,707,698.240	
QUALCOMM INC	124,158	133.200	16,537,845.600	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,036	89.350	1,879,566.600	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	41.230	777,845.180	
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,830	571.810	6,764,512.300	
RESMED INC	15,880	208.510	3,311,138.800	
US BANCORP	156,225	48.720	7,611,282.000	
SEAGEN INC	15,022	139.400	2,094,066.800	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	39,388	45.230	1,781,519.240	
ROSS STORES INC	38,057	77.200	2,938,000.400	

ROLLINS INC	25,920	33.940	879,724.800	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,317	390.690	4,421,438.730	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,975	208.740	2,708,401.500	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	45.750	1,257,072.750	
RPM INTERNATIONAL INC	13,691	80.870	1,107,191.170	
ACCENTURE PLC-CL A	69,668	286.010	19,925,744.680	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	153,098	60.800	9,308,358.400	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,092	199.500	2,611,854.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	25,485	169.300	4,314,610.500	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	67,717	97.800	6,622,722.600	
BOOKING HOLDINGS INC	4,519	2,104.960	9,512,314.240	
SCHLUMBERGER LTD	158,203	47.210	7,468,763.630	
SCHWAB (CHARLES) CORP	160,002	62.220	9,955,324.440	
POOL CORP	4,660	385.030	1,794,239.800	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,769	113.380	2,581,549.220	
BUNGE LTD	14,313	106.960	1,530,918.480	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	54.990	796,090.230	
ANTHEM INC	26,617	482.830	12,851,486.110	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,525	144.450	2,531,486.250	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	30,223	66.330	2,004,691.590	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	27,498	247.420	6,803,555.160	
CENTENE CORP	62,507	79.510	4,969,931.570	
SVB FINANCIAL GROUP	6,419	442.880	2,842,846.720	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	58.060	862,539.360	
SNAP-ON INC	5,270	209.360	1,103,327.200	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,364	98.390	4,168,193.960	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	179.430	1,285,615.950	
EDISON INTERNATIONAL	41,269	66.980	2,764,197.620	
SOUTHERN CO	117,314	72.140	8,463,031.960	
TRUIST FINANCIAL CORP	142,721	45.950	6,558,029.950	
SOUTHWEST AIRLINES	14,171	40.140	568,823.940	
AT&T INC	787,339	20.690	16,290,043.910	
CHEVRON CORP	214,183	175.400	37,567,698.200	
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,912	109.960	2,079,563.520	
STATE STREET CORP	39,935	65.230	2,604,960.050	
STARBUCKS CORP	124,774	75.670	9,441,648.580	
STEEL DYNAMICS INC	20,170	74.130	1,495,202.100	
STRYKER CORP	37,695	216.400	8,157,198.000	
NETFLIX INC	49,263	182.940	9,012,173.220	
NORTONLIFELOCK INC	62,570	22.950	1,435,981.500	

KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	46.040	770,249.200	
SYNOPSIS INC	16,429	305.390	5,017,252.310	
SYSCO CORP	56,522	81.910	4,629,717.020	
INTUITIVE SURGICAL INC	39,921	205.270	8,194,583.670	
TELEFLEX INC	5,532	267.670	1,480,750.440	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	8.320	926,423.680	
TERADYNE INC	18,512	96.970	1,795,108.640	
TEXAS INSTRUMENTS INC	101,408	157.780	16,000,154.240	
TEXTRON INC	21,583	62.940	1,358,434.020	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43,152	526.880	22,735,925.760	
GLOBE LIFE INC	9,737	91.820	894,051.340	
DAVITA INC	6,813	93.160	634,699.080	
TRACTOR SUPPLY CO	12,907	195.300	2,520,737.100	
BIO-TECHNE CORP	4,403	334.550	1,473,023.650	
TRIMBLE INC	28,676	62.520	1,792,823.520	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,516	337.520	1,524,240.320	
TYSON FOODS INC	32,395	84.140	2,725,715.300	
UGI CORP	24,160	42.190	1,019,310.400	
MARATHON OIL CORP	77,325	30.290	2,342,174.250	
UNION PACIFIC CORP	70,393	211.120	14,861,370.160	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	164,503	95.490	15,708,391.470	
UNITEDHEALTH GROUP INC	103,468	484.630	50,143,696.840	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	114.750	929,016.000	
VF CORP	37,887	47.300	1,792,055.100	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	28.090	1,895,148.030	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,252	254.880	7,200,869.760	
VULCAN MATERIALS CO	15,188	156.350	2,374,643.800	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	79,192	41.540	3,289,635.680	
WALMART INC	167,846	121.700	20,426,858.200	
WASTE MANAGEMENT INC	44,978	151.410	6,810,118.980	
WATERS CORP	6,202	329.710	2,044,861.420	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	46.270	1,031,126.950	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,081	293.510	2,371,854.310	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	128.410	1,628,110.390	
VAIL RESORTS INC	4,389	248.650	1,091,324.850	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	54.030	1,913,796.630	
WABTEC CORP	20,273	90.250	1,829,638.250	
WHIRLPOOL CORP	5,887	164.350	967,528.450	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	100.250	1,888,008.250	
WYNN RESORTS LTD	12,757	62.290	794,633.530	

NASDAQ INC	11,841	150.190	1,778,399.790	
CME GROUP INC	39,734	199.900	7,942,826.600	
WILLIAMS COS INC	130,418	34.890	4,550,284.020	
LKQ CORP	31,863	49.550	1,578,811.650	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	59.320	1,724,195.120	
WEC ENERGY GROUP INC	35,483	99.310	3,523,816.730	
CARMAX INC	18,673	96.030	1,793,168.190	
TJX COMPANIES INC	132,377	58.970	7,806,271.690	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	305.350	1,819,275.300	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	5.090	582,036.410	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	21,528	57.230	1,232,047.440	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,928	132.110	1,707,918.080	
SIGNATURE BANK	6,557	201.620	1,322,022.340	
CBRE GROUP INC	37,573	73.350	2,755,979.550	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	22.430	353,922.970	
REGIONS FINANCIAL CORP	108,483	20.140	2,184,847.620	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	380.500	1,565,757.500	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,852	423.620	2,055,404.240	
WESTLAKE CORP	4,187	122.650	513,535.550	
T-MOBILE US INC	69,136	130.510	9,022,939.360	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	33.500	1,284,725.000	
MOSAIC CO/THE	42,561	53.360	2,271,054.960	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	273.890	1,148,420.770	
CELANESE CORP	11,567	145.720	1,685,543.240	
DEXCOM INC	10,520	293.850	3,091,302.000	
EXPEDIA GROUP INC	15,713	115.160	1,809,509.080	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,948	87.720	1,925,278.560	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,524	251.580	3,150,787.920	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	23.470	845,717.980	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	60,252	97.780	5,891,440.560	
LIVE NATION	18,129	92.310	1,673,487.990	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,026	1,317.040	3,985,363.040	
TRANSDIGM GROUP INC	5,694	581.130	3,308,954.220	
MASTERCARD INC	96,033	334.750	32,147,046.750	
WESTERN UNION CO	46,712	17.130	800,176.560	
OWENS CORNING	10,366	89.290	925,580.140	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,304	100.720	1,339,978.880	
AERCAP HOLDINGS NV	13,522	44.620	603,351.640	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	12,312	140.090	1,724,788.080	
DELTA AIR LINES INC	15,786	35.120	554,404.320	

INSULET CORP	8,015	221.210	1,772,998.150	
DISCOVER FINANCIAL	32,568	98.140	3,196,223.520	
TE CONNECTIVITY LTD	34,852	123.380	4,300,039.760	
MASIMO CORP	5,688	138.640	788,584.320	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,211	291.600	3,852,327.600	
VMWARE INC	22,568	125.410	2,830,252.880	
MERCADOLIBRE INC	4,908	691.690	3,394,814.520	
ULTA BEAUTY INC	5,573	407.720	2,272,223.560	
INVESCO LTD	38,530	17.280	665,798.400	
MSCI INC	8,933	410.050	3,662,976.650	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	170,601	102.330	17,457,600.330	
VISA INC	182,475	199.510	36,405,587.250	
KEURIG DR PEPPER INC	85,519	35.490	3,035,069.310	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,811	148.270	2,937,376.970	
MARATHON PETROLEUM CORP	62,928	108.340	6,817,619.520	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,542	65.190	882,802.980	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	229,919	19.030	4,375,358.570	
XYLEM INC	20,869	80.140	1,672,441.660	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,786	102.570	3,055,150.020	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	211.990	999,108.870	
SPLUNK INC	18,478	98.460	1,819,343.880	
EPAM SYSTEMS INC	6,493	303.490	1,970,560.570	
HCA HEALTHCARE INC	27,031	196.720	5,317,538.320	
VERISK ANALYTICS INC	17,368	164.100	2,850,088.800	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	147.500	966,715.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	237.180	2,097,619.920	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	19,974	141.470	2,825,721.780	
NXP SEMICONDUCTOR NV	29,250	178.570	5,223,172.500	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	84.910	1,226,524.950	
TARGA RESOURCES CORP	22,659	72.430	1,641,191.370	
LEAR CORP	7,443	133.660	994,831.380	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,131	109.770	1,221,849.870	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	27,217	60.510	1,646,900.670	
DOLLAR GENERAL CORP	25,952	233.360	6,056,158.720	
FORTINET INC	15,301	288.310	4,411,431.310	
HORIZON PHARMA PLC	24,711	85.420	2,110,813.620	
TESLA INC	96,626	696.690	67,318,367.940	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	261.500	1,808,011.000	
ENPHASE ENERGY INC	14,394	196.190	2,823,958.860	

GENERAL MOTORS CO	147,099	35.010	5,149,935.990	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	37.550	1,473,086.500	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,608	188.650	1,623,899.200	
APTIV PLC	29,920	101.320	3,031,494.400	
PHILLIPS 66	53,553	106.310	5,693,219.430	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	75.170	688,406.860	
META PLATFORMS INC	254,140	175.570	44,619,359.800	
IQVIA HOLDINGS INC	20,476	207.370	4,246,108.120	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,801	155.490	2,923,367.490	
SERVICENOW INC	22,303	473.150	10,552,664.450	
PALO ALTO NETWORKS INC	10,588	495.220	5,243,389.360	
WORKDAY INC	21,127	149.280	3,153,838.560	
ABBVIE INC	194,904	143.200	27,910,252.800	
ZOETIS INC	52,455	161.490	8,470,957.950	
NEWS CORP/NEW-CL A	40,345	16.570	668,516.650	
CDW CORP	15,325	167.340	2,564,485.500	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	33.980	1,441,193.740	
TWILIO INC	19,489	90.730	1,768,236.970	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	60.400	493,830.400	
SNAP INC	127,318	13.280	1,690,783.040	
TRADE DESK INC A	47,521	49.270	2,341,359.670	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	22,466	59.720	1,341,669.520	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	38.460	340,178.700	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	38.410	763,245.110	
OKTA INC	17,933	90.120	1,616,121.960	
BLACK KNIGHT INC	17,653	66.510	1,174,101.030	
BAKER HUGHES CO	102,141	35.230	3,598,427.430	
BROADCOM INC	45,098	541.270	24,410,194.460	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,939	54.270	539,389.530	
MONGODB INC	7,256	268.710	1,949,759.760	
BURLINGTON STORES INC	7,274	168.230	1,223,705.020	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	42,679	22.270	950,461.330	
VEEVA SYSTEMS INC	15,824	183.660	2,906,235.840	
TWITTER INC	85,912	38.980	3,348,849.760	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	16,816	46.010	773,704.160	
EVERGY INC	23,678	66.750	1,580,506.500	
ALLEGION PLC	9,404	107.120	1,007,356.480	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14,074	52.360	736,914.640	
STERIS PLC	10,912	220.890	2,410,351.680	
DOCUSIGN INC	21,673	65.930	1,428,900.890	
WIX.COM LTD	5,855	57.630	337,423.650	
DROPBOX INC	30,479	22.070	672,671.530	
KKR & CO INC	59,685	51.050	3,046,919.250	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	44.830	226,391.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	23,682	109.070	2,582,995.740	

MODERNA INC	36,681	127.120	4,662,888.720	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	30,527	127.470	3,891,276.690	
ARAMARK	22,573	32.950	743,780.350	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	12.430	744,407.840	
CIGNA CORP	35,528	253.290	8,998,887.120	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	49.160	1,610,973.200	
DOW INC	80,015	61.870	4,950,528.050	
AMCOR PLC	172,505	12.760	2,201,163.800	
PINTEREST INC	62,041	19.240	1,193,668.840	
PELOTON INTERACTIVE INC	27,064	10.510	284,442.640	
FOX CORP-A	36,501	32.390	1,182,267.390	
FOX CORP-B	15,511	30.030	465,795.330	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	13.970	594,926.420	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	21,318	169.320	3,609,563.760	
CHEWY INC	9,648	28.720	277,090.560	
AVANTOR INC	65,960	30.760	2,028,929.600	
LYFT INC	26,175	15.770	412,779.750	
DYNATRACE INC	20,512	41.360	848,376.320	
CLOUDFLARE INC	25,638	47.360	1,214,215.680	
TRADEWEB MARKETS INC	10,585	67.840	718,086.400	
CARRIER GLOBAL CORP	96,284	37.340	3,595,244.560	
OTIS WORLDWIDE CORP	47,759	73.290	3,500,257.110	
UBER TECHNOLOGIES INC	156,342	23.720	3,708,432.240	
CORTEVA INC	78,536	57.980	4,553,517.280	
MATCH GROUP INC	32,707	76.680	2,507,972.760	
BILL.COM HOLDINGS INC	10,180	117.850	1,199,713.000	
BLACKSTONE INC	77,454	107.630	8,336,374.020	
CARLYLE GROUP INC	24,530	35.960	882,098.800	
DATADOG INC	24,280	96.200	2,335,736.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	80.610	1,798,247.880	
UPSTART HOLDINGS INC	4,442	37.490	166,530.580	
INGERSOLL RAND INC	42,467	46.440	1,972,167.480	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,733	294.390	1,687,737.870	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	18,691	28.360	530,076.760	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	52.130	483,088.710	
UNITY SOFTWARE INC	21,046	36.900	776,597.400	
AON PLC	23,670	253.640	6,003,658.800	
WARNER BROS DISCOVERY INC	238,237	14.860	3,540,201.820	
BENTLEY SYSTEMS INC	17,230	33.060	569,623.800	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	58.710	768,748.740	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	20.440	378,712.320	
IAC/INTERACTIVECORP	7,652	82.980	634,962.960	
AIRBNB INC	35,884	108.910	3,908,126.440	
ZENDESK INC	12,612	64.970	819,401.640	

CONSTELLATION ENERGY CORP	37,045	59.790	2,214,920.550	
APPROVIN CORP	13,206	36.110	476,868.660	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	40.480	1,518,080.960	
ROBLOX CORP	38,445	27.760	1,067,233.200	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	34.970	1,037,070.320	
VIATRIS INC	132,223	11.200	1,480,897.600	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	45.500	1,053,143.000	
SNOWFLAKE INC	23,111	122.420	2,829,248.620	
DOORDASH INC	20,697	62.180	1,286,939.460	
ARISTA NETWORKS INC	26,276	94.960	2,495,168.960	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	43,099	54.450	2,346,740.550	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	8.260	1,499,718.640	
FNF GROUP	31,004	38.950	1,207,605.800	
MARVELL TECHNOLOGY INC	94,210	53.070	4,999,724.700	
APA CORP	37,156	48.810	1,813,584.360	
LUCID GROUP INC	44,910	18.020	809,278.200	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	2.710	306,544.360	
CATALENT INC	18,217	106.670	1,943,207.390	
SYNCHRONY FINANCIAL	55,391	31.510	1,745,370.410	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	56,943	36.590	2,083,544.370	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,756	132.710	498,458.760	
WAYFAIR INC	7,350	51.550	378,892.500	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	20,584	140.530	2,892,669.520	
HUBSPOT INC	4,932	325.600	1,605,859.200	
QORVO INC	11,596	101.250	1,174,095.000	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,800	118.650	1,874,670.000	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	5,852	284.360	1,664,074.720	
GODADDY INC	17,571	70.760	1,243,323.960	
KORNIT DIGITAL LTD	5,217	38.090	198,715.530	
ETSY INC	13,841	75.840	1,049,701.440	
TRANSUNION	20,148	79.270	1,597,131.960	
ALCOA CORP	19,669	53.010	1,042,653.690	
BLOCK INC	58,712	71.870	4,219,631.440	
DUPONT DE NEMOURS INC	57,674	63.530	3,664,029.220	
CARVANA CO	8,245	22.010	181,472.450	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	52.740	1,181,850.660	
TELADOC HEALTH INC	15,648	31.740	496,667.520	
WESTROCK CO	27,826	45.120	1,255,509.120	
KRAFT HEINZ CO	79,678	37.450	2,983,941.100	

	NOVOCURE LTD	10,423	69.450	723,877.350	
	FORTIVE CORP	38,946	59.160	2,304,045.360	
	WASTE CONNECTIONS INC	29,250	123.550	3,613,837.500	
	ALPHABET INC-CL A	33,078	2,223.230	73,540,001.940	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	144,397	14.230	2,054,769.310	
	PAYPAL HOLDINGS INC	122,941	79.300	9,749,221.300	
	SEA LTD ADR	38,956	76.280	2,971,563.680	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	27.330	1,227,772.920	
	ZILLOW GROUP INC-C	16,321	35.440	578,416.240	
	ALPHABET INC-CL C	31,227	2,228.550	69,590,930.850	
	ZSCALER INC	9,242	153.610	1,419,663.620	
	CABLE ONE INC	570	1,282.530	731,042.100	
	LINDE PLC	56,489	310.890	17,561,865.210	
	ROKU INC	12,563	82.710	1,039,085.730	
	AVALARA INC	11,113	79.570	884,261.410	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,396	474.190	6,352,249.240	
	VISTRA CORP	42,712	25.440	1,086,593.280	
アメリカ・ドル	小計	36,031,084		3,724,017,905.610 (502,742,417,254)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	14.330	658,649.790	
	ASHTREAD GROUP	50,699	39.280	1,991,456.720	
	SEVERN TRENT PLC	31,097	28.840	896,837.480	
	BARCLAYS PLC	1,794,161	1.598	2,867,069.270	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.945	614,149.220	
	BT GROUP PLC	756,852	1.781	1,347,953.410	
	BUNZL PLC	38,593	26.360	1,017,311.480	
	AVIVA PLC	303,762	4.054	1,231,451.140	
	CRODA INTERNATIONAL	14,503	63.840	925,871.520	
	DIAGEO PLC	255,104	35.355	9,019,201.920	
	SCHRODERS PLC	12,178	26.960	328,318.880	
	DCC PLC	11,135	54.340	605,075.900	
	NATIONAL GRID PLC	392,884	10.820	4,251,004.880	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.449	551,985.000	
	BAE SYSTEMS PLC	350,927	7.712	2,706,349.020	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	240,490	34.930	8,400,315.700	
	HALMA PLC	41,997	20.880	876,897.360	
	NEXT PLC	13,982	61.800	864,087.600	
	IMPERIAL BRANDS PLC	96,595	17.920	1,730,982.400	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	20.390	407,310.640	
	ANGLO AMERICAN PLC	136,421	36.130	4,928,890.730	
	COMPASS GROUP PLC	191,530	17.440	3,340,283.200	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,241,227	4.991	11,185,963.950	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	643,354	2.425	1,560,133.450	
	UNILEVER PLC	283,588	36.395	10,321,185.260	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	10.460	749,103.360	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	16.030	678,886.530	
PEARSON PLC	86,953	7.406	643,973.910	
PERSIMMON PLC	35,252	21.920	772,723.840	
PRUDENTIAL PLC	309,558	9.850	3,049,146.300	
RIO TINTO PLC	124,185	56.900	7,066,126.500	
VODAFONE GROUP PLC	3,044,680	1.254	3,818,028.720	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	76,722	60.420	4,635,543.240	
RELX PLC	207,105	21.580	4,469,325.900	
RENTOKIL INITIAL PLC	204,183	4.789	977,832.380	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	847,047	0.879	744,554.310	
NATWEST GROUP PLC	606,899	2.216	1,344,888.180	
ST JAMES'S PLACE PLC	70,204	11.690	820,684.760	
SSE PLC	117,097	17.545	2,054,466.860	
BP PLC	2,148,604	4.374	9,397,993.890	
SAGE GROUP PLC(THE)	99,190	6.236	618,548.840	
SMITHS GROUP PLC	37,796	15.020	567,695.920	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	98.400	879,302.400	
STANDARD CHARTERED PLC	300,878	5.818	1,750,508.200	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,603,054	0.437	3,322,534.590	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	1.259	452,628.120	
TESCO PLC	846,543	2.501	2,117,204.040	
3I GROUP PLC	107,283	11.510	1,234,827.330	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	12.090	1,125,167.940	
GSK PLC	560,988	17.366	9,742,117.600	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	36,657	70.520	2,585,051.640	
WPP PLC	120,328	8.440	1,015,568.320	
ASTRAZENECA PLC	170,786	98.510	16,824,128.860	
WHITBREAD PLC	25,470	26.770	681,831.900	
INTERTEK GROUP PLC	17,114	43.770	749,079.780	
BURBERRY GROUP PLC	41,060	16.365	671,946.900	
INTERCONTINENTAL HOTELS	22,347	46.810	1,046,063.070	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.133	409,742.900	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	21.410	456,568.250	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	40.530	460,420.800	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	15.835	292,234.920	
AVEVA GROUP PLC	10,907	24.340	265,476.380	
ABRDN PLC	213,433	1.746	372,654.010	
EXPERIAN PLC	100,148	24.230	2,426,586.040	
MONDI PLC	58,887	14.670	863,872.290	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.900	291,841.800	
OCADO GROUP PLC	46,768	9.168	428,769.020	

	INFORMA PLC	157,970	5.358	846,403.260	
	GLENCORE PLC	1,099,145	5.055	5,556,177.970	
	ENTAIN PLC	61,865	14.085	871,368.520	
	COCA-COLA HBC AG	21,338	17.075	364,346.350	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	6.148	530,099.000	
	FERGUSON PLC	24,704	91.460	2,259,427.840	
	M&G PLC	270,401	2.070	559,730.070	
	JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.167	294,294.060	
	SHELL PLC	835,926	23.380	19,543,949.880	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.526	612,463.150	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.543	751,760.400	
イギリス・ポンド 小計		30,878,186		197,694,406.960 (32,755,986,289)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	146,703	30.570	4,484,710.710	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	152,152	31.600	4,808,003.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	660.000	1,684,980.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	159.800	2,009,325.200	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.750	3,055,200.000	
	ICL GROUP LTD	72,257	33.860	2,446,622.020	
	NICE LTD	6,507	674.500	4,388,971.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	112.000	1,953,280.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	234.200	1,094,182.400	
イスラエル・シュケル 小計		577,802		25,925,275.030 (1,031,841,501)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	22,674	77.470	1,756,554.780	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	303,672	23.070	7,005,713.040	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	377,160	20.850	7,863,786.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	194,047	21.450	4,162,308.150	
	TELSTRA CORP LTD	415,558	3.800	1,579,120.400	
	ASX LTD	20,036	78.460	1,572,024.560	
	BHP GROUP LTD	559,896	46.220	25,878,393.120	
	AMPOL LTD	22,528	35.310	795,463.680	
	COMPUTERSHARE LT	55,283	23.170	1,280,907.110	
	CSL LIMITED	53,441	271.380	14,502,818.580	
	REA GROUP LTD	6,134	105.400	646,523.600	
	TRANSURBAN GROUP	338,249	14.260	4,823,430.740	
	COCHLEAR LTD	7,987	214.540	1,713,530.980	
	ORIGIN ENERGY LTD	164,274	6.160	1,011,927.840	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	188,312	93.780	17,659,899.360	
	RIO TINTO LIMITED	39,763	115.900	4,608,531.700	
	APA GROUP	125,299	11.470	1,437,179.530	
ARISTOCRAT LEISU	65,513	34.790	2,279,197.270		

INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.180	1,177,355.520	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	49,035	34.870	1,709,850.450	
ORICA LTD	43,659	16.160	705,529.440	
LEND LEASE CORP LTD	65,475	10.000	654,750.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	17.510	881,190.750	
MACQUARIE GROUP LTD	39,773	172.360	6,855,274.280	
SUNCORP GROUP LTD	127,921	10.750	1,375,150.750	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	349,560	28.060	9,808,653.600	
NEWCREST MINING LTD	98,073	23.420	2,296,869.660	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.160	581,320.440	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	147,246	11.980	1,764,007.080	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	8.320	1,128,008.960	
REECE LTD	31,558	14.150	446,545.700	
SANTOS LTD	359,516	8.530	3,066,671.480	
SONIC HEALTHCARE	52,774	33.740	1,780,594.760	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	24.800	644,428.000	
WESFARMERS LTD	123,983	43.670	5,414,337.610	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	212,013	34.820	7,382,292.660	
WOOLWORTHS GROUP LTD	136,700	34.330	4,692,911.000	
SEEK LTD	38,405	22.230	853,743.150	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	62.410	392,184.440	
MINERAL RESOURCES LTD	16,953	56.810	963,099.930	
BRAMBLES LTD	172,951	10.720	1,854,034.720	
CROWN RESORTS LTD	35,145	13.050	458,642.250	
EVOLUTION MINING LTD	224,674	3.500	786,359.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	257,097	4.120	1,059,239.640	
TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	11.090	878,693.970	
XERO LTD	14,590	82.930	1,209,948.700	
IDP EDUCATION LTD	23,781	23.200	551,719.200	
LOTTERY CORP LTD	227,460	4.550	1,034,943.000	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	7.150	1,147,360.500	
MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.150	940,514.400	
SOUTH32 LTD(AUD)	489,406	4.800	2,349,148.800	
COLES GROUP LTD	151,233	17.380	2,628,429.540	
WISETECH GLOBAL LTD	14,823	38.990	577,948.770	
オーストラリア・ドル 小計	7,614,404		170,629,062.590 (16,144,921,902)	
カナダ・ドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	48,157	68.980	3,321,869.860	
BARRICK GOLD CORP	191,843	26.890	5,158,658.270	

BANK OF MONTREAL	71,431	131.480	9,391,747.880	
BANK OF NOVA SCOTIA	133,706	81.940	10,955,869.640	
NATIONAL BANK OF CANADA	38,087	92.720	3,531,426.640	
BCE INC	7,697	67.110	516,545.670	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	156,360	60.280	9,425,380.800	
BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	10.250	310,062.500	
SAPUTO INC	26,668	26.950	718,702.600	
BLACKBERRY LTD	49,855	7.080	352,973.400	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	83,214	18.120	1,507,837.680	
CGI INC	22,260	100.710	2,241,804.600	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	59.290	970,162.270	
CAE INC	32,283	31.230	1,008,198.090	
CAMECO CORP	45,781	32.620	1,493,376.220	
ROGERS COMM-CL B	40,412	61.290	2,476,851.480	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	97,325	67.330	6,552,892.250	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	130,526	82.830	10,811,468.580	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	166.720	1,020,993.280	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	39.650	647,484.500	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	65,971	140.460	9,266,286.660	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	37.350	810,980.550	
OPEN TEXT CORP	33,913	49.310	1,672,250.030	
EMPIRE CO LTD	16,169	40.880	660,988.720	
KINROSS GOLD CORP	123,889	5.780	716,078.420	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	76.380	1,014,784.680	
FORTIS INC	54,416	62.350	3,392,837.600	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	64,491	34.250	2,208,816.750	
TELUS CORP	31,890	30.360	968,180.400	
GREAT WEST LIFECO INC	26,893	32.320	869,181.760	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	69.190	1,885,150.740	
ENBRIDGE INC	223,981	58.180	13,031,214.580	
IGM FINANCIAL INC	12,478	37.080	462,684.240	
MANULIFE FINANCIAL CORP	219,912	22.790	5,011,794.480	
LOBLAW CO LTD	18,620	114.930	2,139,996.600	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	90,988	54.700	4,977,043.600	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	78.330	2,532,252.240	
SUN LIFE FINANCIAL INC	63,898	61.170	3,908,640.660	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,529	665.930	1,684,136.970	
METRO INC	23,793	69.120	1,644,572.160	
EMERA INC	31,449	62.170	1,955,184.330	
ONEX CORP	7,000	73.230	512,610.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	29.900	577,757.700	

POWER CORP OF CANADA	59,749	35.070	2,095,397.430	
QUEBECOR INC-B	17,195	27.170	467,188.150	
ROYAL BANK OF CANADA	155,160	128.550	19,945,818.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	103,452	89.100	9,217,573.200	
SHAW COMM INC-B	52,487	35.290	1,852,266.230	
SUNCOR ENERGY INC	158,211	52.780	8,350,376.580	
LUNDIN MINING CORP	68,762	10.750	739,191.500	
TECK RESOURCES LTD-CL B	52,091	54.010	2,813,434.910	
THOMSON REUTERS CORP	17,791	124.800	2,220,316.800	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	106.350	1,027,872.750	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	200,184	91.620	18,340,858.080	
TC ENERGY CORP	109,283	72.620	7,936,131.460	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,698	111.890	1,085,109.220	
WESTON (GEORGE) LTD	8,379	150.050	1,257,268.950	
INTACT FINANCIAL CORP	18,757	181.080	3,396,517.560	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	55,227	53.980	2,981,153.460	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,211	1,872.150	4,139,323.650	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	21,959	187.490	4,117,092.910	
TOURMALINE OIL CORP	33,964	75.580	2,566,999.120	
KEYERA CORP	24,571	34.330	843,522.430	
PARKLAND CORP	15,665	38.580	604,355.700	
ALTAGAS LTD	26,009	29.410	764,924.690	
PEMBINA PIPELINE CORP	60,655	51.570	3,127,978.350	
DOLLARAMA INC	32,535	71.430	2,323,975.050	
CENOVUS ENERGY INC W/I	149,503	30.090	4,498,545.270	
ARC RESOURCES LTD	74,961	21.230	1,591,422.030	
NORTHLAND POWER INC	25,030	39.760	995,192.800	
TMX GROUP LTD	7,040	135.170	951,596.800	
BRP INC	4,307	81.280	350,072.960	
IVANHOE MINES LTD	64,027	10.020	641,550.540	
NUTRIEN LTD	62,052	110.410	6,851,161.320	
TFI INTERNATIONAL INC	9,399	98.410	924,955.590	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	30.290	368,023.500	
WSP GLOBAL INC	13,275	143.030	1,898,723.250	
IA FINANCIAL CORP INC	12,011	63.420	761,737.620	
GFL ENVIRONMENTAL INC	17,254	36.380	627,700.520	
NUVEI CORP	7,929	57.980	459,723.420	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	11,764	47.380	557,378.320	
AIR CANADA	18,814	20.250	380,983.500	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,443	64.050	2,077,974.150	
SHOPIFY INC	12,382	444.850	5,508,132.700	
FIRSTSERVICE CORP	5,321	154.440	821,775.240	

	HYDRO ONE LTD	37,626	34.510	1,298,473.260	
カナダ・ドル 小計		4,361,796		268,097,499.050 (28,270,881,275)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	4.090	589,778.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	203,210	30.130	6,122,717.300	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	8.250	325,050.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.670	965,066.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.775	589,924.570	
	KEPPEL CORP LTD	144,600	6.900	997,740.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	368,898	11.610	4,282,905.780	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	855,130	2.520	2,154,927.600	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.320	865,564.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,766	27.680	3,591,922.880	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	7.330	319,588.000	
	VENTURE CORP LTD	22,300	17.510	390,473.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	4.140	804,816.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.840	1,177,305.600	
シンガポール・ドル 小計		3,475,787		23,177,778.730 (2,249,403,426)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	287,785	6.198	1,783,691.430	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	54.740	1,039,129.420	
	NESTLE SA-REGISTERED	309,476	110.100	34,073,307.600	
	CIE FINANC RICHEMONT	58,207	103.900	6,047,707.300	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	77,757	313.950	24,411,810.150	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,208	183.000	770,064.000	
	SIKA INHABER	15,630	246.300	3,849,669.000	
	SGS SA-REG	650	2,231.000	1,450,150.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	240,822	83.920	20,209,782.240	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	154.900	879,057.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	344	2,116.000	727,904.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	19.030	401,000.160	
	SWISSCOM AG-REG	2,626	538.600	1,414,363.600	
	ABB LTD	178,308	28.800	5,135,270.400	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	35.620	706,772.040	
	GEBERIT AG	4,189	504.400	2,112,931.600	
	LONZA GROUP AG-REG	8,013	543.000	4,351,059.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	9,510.000	1,112,670.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	97,800.000	1,075,800.000	
	GIVAUDAN-REG	1,040	3,334.000	3,467,360.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,632	422.400	7,025,356.800		
ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,595	361.600	938,352.000		
HOLCIM LTD	59,521	46.420	2,762,964.820		

TEMENOS GROUP	7,082	81.180	574,916.760	
BACHEM HOLDING AG	2,630	73.300	192,779.000	
SONOVA HOLDING AG	6,135	326.300	2,001,850.500	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	230.400	1,372,953.600	
STRAUMANN HOLDING AG	11,500	108.850	1,251,775.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	237.100	742,123.000	
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	44.980	226,069.480	
SCHINDLER NAMEN	2,720	180.200	490,144.000	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	526.800	1,901,748.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	810	765.500	620,055.000	
SWISS PRIME SITE AG	8,372	90.750	759,759.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,452	944.800	2,316,649.600	
JULIUS BAER GROUP LTD	26,896	48.150	1,295,042.400	
SWISS RE LTD	32,886	77.040	2,533,537.440	
ALCON INC	53,961	69.300	3,739,497.300	
VIFOR PHARMA AG	5,556	172.500	958,410.000	
UBS GROUP AG	390,645	16.620	6,492,519.900	
VAT GROUP AG	3,325	256.800	853,860.000	
スイス・フラン 小計	1,906,198		154,069,863.040 (21,013,588,620)	
スウェーデン・ クローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	288,140	105.620	30,433,346.800	
ATLAS COPCO AB-B SHS	168,168	92.680	15,585,810.240	
ERICSSON LM-B SHS	330,309	76.380	25,229,001.420	
GETINGE AB-B SHS	25,755	273.600	7,046,568.000	
INVESTOR AB-A SHS	58,437	194.600	11,371,840.200	
LUNDBERGS B	7,859	442.600	3,478,393.400	
SKF AB-B SHS	46,594	168.750	7,862,737.500	
SANDVIK AB	114,819	194.500	22,332,295.500	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	179,371	109.150	19,578,344.650	
SKANSKA AB-B SHS	33,216	164.850	5,475,657.600	
SWEDBANK AB	94,382	149.550	14,114,828.100	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	167.500	11,760,342.500	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	95.900	15,539,252.400	
VOLVO AB-A SHS	24,198	179.600	4,345,960.800	
VOLVO AB-B SHS	158,684	171.060	27,144,485.040	
HOLMEN AB-B SHS	10,142	469.100	4,757,612.200	
SWEDISH MATCH AB	167,443	101.100	16,928,487.300	
TELE2 AB-B SHS	64,416	117.550	7,572,100.800	
INDUSTRIVARDEN A	15,292	244.700	3,741,952.400	
INDUSTRIVARDEN C	22,221	241.700	5,370,815.700	
ELECTROLUX AB-SER B	26,907	143.420	3,859,001.940	
SECURITAS AB-B SHS	44,038	93.220	4,105,222.360	
INVESTOR AB-B SHS	207,926	176.240	36,644,878.240	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	135.900	11,182,803.300	

	ASSA ABLOY AB-B	109,539	234.700	25,708,803.300	
	TELIA CO AB	283,582	39.030	11,068,205.460	
	LUNDIN ENERGY AB	21,720	476.100	10,340,892.000	
	BOLIDEN AB	29,779	385.500	11,479,804.500	
	ALFA LAVAL AB	27,935	246.800	6,894,358.000	
	KINNEVIK AB-B	22,633	173.850	3,934,747.050	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	59.090	4,310,142.780	
	INDUTRADE AB	29,769	214.800	6,394,381.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	83.640	3,995,399.160	
	NIBE INDUSTRIER AB	160,889	79.340	12,764,933.260	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	215.000	3,951,700.000	
	HEXAGON AB-B SHS	226,553	116.750	26,450,062.750	
	SAGAX AB	19,038	229.700	4,373,028.600	
	EPIROC AB-A	71,353	183.350	13,082,572.550	
	EPIROC AB-B	41,205	159.000	6,551,595.000	
	ESSITY AB-B	66,425	258.600	17,177,505.000	
	EQT AB	31,718	237.100	7,520,337.800	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	89.360	7,130,123.760	
	VOLVO CAR AB	63,710	83.060	5,291,752.600	
	LIFCO AB	26,835	179.850	4,826,274.750	
	EVOLUTION AB	19,664	936.000	18,405,504.000	
	NORDEA BANK ABP	349,481	96.510	33,728,411.310	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	219.700	3,413,918.300	
	SINCH AB	59,403	39.745	2,360,972.230	
	スウェーデン・クローナ 小計	4,298,503		566,617,163.750 (7,604,002,338)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	857.200	9,350,337.600	
	A P MOLLER A/S	557	18,470.000	10,287,790.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	18,260.000	6,555,340.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	111.100	8,097,745.700	
	GENMAB A/S	7,409	2,066.000	15,306,994.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,453	419.200	8,573,897.600	
	ROCKWOOL AS	873	1,850.500	1,615,486.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	185,966	785.600	146,094,889.600	
	GN STORE NORD A/S	15,343	251.500	3,858,764.500	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	114,856	175.500	20,157,228.000	
	COLOPLAST-B	12,609	787.200	9,925,804.800	
	DSV A/S	20,770	1,045.000	21,704,650.000	
	DEMANT A/S	11,367	289.400	3,289,609.800	
	TRYG A/S	37,118	157.150	5,833,093.700	
	PANDORA A/S	9,912	511.200	5,067,014.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	13,302	490.700	6,527,291.400	
	ORSTED A/S	20,956	755.700	15,836,449.200	
	デンマーク・クローネ 小計	555,645		298,082,386.800 (5,669,526,997)	

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.690	1,263,782.290	
	FISHER & PAYKEL	60,887	20.340	1,238,441.580	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	4.760	1,042,620.880	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.740	360,667.160	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	4.670	617,173.190	
ニュージーランド・ドル 小計		639,257		4,522,685.100 (386,734,803)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	234.600	10,675,238.400	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	66.480	10,834,312.080	
	TELENOR ASA	71,764	125.750	9,024,323.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	324.800	3,632,888.000	
	ORKLA ASA	72,906	72.040	5,252,148.240	
	EQUINOR ASA	110,053	351.200	38,650,613.600	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,042	471.000	7,555,782.000	
	AKER BP ASA	15,719	407.600	6,407,064.400	
	SALMAR ASA	7,248	670.000	4,856,160.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,304	196.100	3,197,214.400	
	ADEVINTA ASA	24,382	74.950	1,827,430.900	
	DNB BANK ASA	94,638	184.900	17,498,566.200	
ノルウェー・クローネ 小計		648,716		119,411,741.220 (1,650,270,264)	
ユーロ	CRH PLC	85,408	35.275	3,012,767.200	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,911	100.800	1,805,428.800	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	92.900	1,697,097.200	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	74.100	1,293,119.100	
	UMICORE	24,290	39.770	966,013.300	
	AIR LIQUIDE	55,566	139.120	7,730,341.920	
	AIRBUS SE	65,642	102.000	6,695,484.000	
	AXA SA	209,003	22.580	4,719,287.740	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	72,439	25.250	1,829,084.750	
	ADIDAS AG	19,278	175.700	3,387,144.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	118,133	15.680	1,852,325.440	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	156.000	486,720.000	
	DANONE	70,858	52.650	3,730,673.700	
	SAFRAN SA	37,151	91.670	3,405,632.170	
	INTESA SANPAOLO	1,904,517	1.821	3,468,125.450	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,364	80.540	2,767,676.560	
	ACCOR SA	18,305	29.160	533,773.800	
	BOUYGUES	21,922	31.230	684,624.060	
	BNP PARIBAS	120,850	48.600	5,873,310.000	
	THALES SA	11,069	111.650	1,235,853.850	
	CAPGEMINI SA	18,571	169.850	3,154,284.350	
	UNICREDIT SPA	241,149	9.606	2,316,477.290	
D'IETEREN TRDG	2,736	148.000	404,928.000		

KONINKLIJKE DSM NV	18,896	153.450	2,899,591.200	
COMMERZBANK AG	112,781	7.730	871,797.130	
EIFFAGE	8,993	92.280	829,874.040	
FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	30.030	1,469,908.440	
UNITED INTERNET	10,010	28.810	288,388.100	
PUBLICIS GROUPE	26,472	47.210	1,249,743.120	
IBERDROLA SA	646,124	10.310	6,661,538.440	
ENI SPA	278,442	13.240	3,686,572.080	
JERONIMO MARTINS	34,644	18.420	638,142.480	
KESKO OYJ-B	35,252	22.360	788,234.720	
KBC GROUPE	28,279	54.980	1,554,779.420	
HANNOVER RUECK SE	7,318	137.200	1,004,029.600	
WARTSILA OYJ	50,956	7.506	382,475.730	
L'OREAL	26,710	314.750	8,406,972.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,659	572.900	17,564,541.100	
GEA GROUP AG	17,490	35.830	626,666.700	
BOLLORE	114,808	4.750	545,338.000	
MEDIOBANCA SPA	60,688	9.016	547,163.000	
MICHELIN(CGDE)-B	19,444	117.500	2,284,670.000	
CONTINENTAL AG	13,727	73.640	1,010,856.280	
DEUTSCHE POST AG-REG	106,721	34.815	3,715,491.610	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	17.940	399,900.540	
OMV AG	14,047	48.780	685,212.660	
VERBUND AG	7,320	96.350	705,282.000	
PERNOD-RICARD	22,607	174.800	3,951,703.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	16,854	72.700	1,225,285.800	
RENAULT SA	19,671	26.335	518,035.780	
REPSOL SA	161,783	15.485	2,505,209.750	
REMY COINTREAU	1,986	165.200	328,087.200	
MERCK KGAA	13,847	168.650	2,335,296.550	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	56,955	52.690	3,000,958.950	
RWE AG	69,945	40.700	2,846,761.500	
SEB SA	2,596	92.900	241,168.400	
SOCIETE GENERALE-A	93,202	23.350	2,176,266.700	
VINCI S.A.	58,131	88.180	5,125,991.580	
SODEXO	9,822	68.300	670,842.600	
SOFINA	1,449	205.400	297,624.600	
SOLVAY SA	9,713	88.900	863,485.700	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	60,215	123.500	7,436,552.500	
VIVENDI SE	76,073	10.980	835,281.540	
SAP SE	115,170	89.030	10,253,585.100	
TELEFONICA S.A	614,947	4.483	2,756,807.400	
TOTALENERGIES SE	272,937	54.500	14,875,066.500	
VALEO	26,570	20.840	553,718.800	
E.ON SE	236,021	9.522	2,247,391.960	

VOEST-ALPINE AG	10,593	27.220	288,341.460	
HENKEL AG & CO KGAA	10,815	59.550	644,033.250	
SIEMENS AG-REG	84,608	115.100	9,738,380.800	
UPM-KYMMENE OYJ	62,113	32.150	1,996,932.950	
ING GROEP NV-CVA	423,618	9.751	4,130,699.110	
PUMA AG	10,980	69.300	760,914.000	
BAYER AG	109,090	63.560	6,933,760.400	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	16.660	975,193.100	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	60.020	1,179,032.880	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	89,207	64.910	5,790,426.370	
BASF SE	99,696	49.630	4,947,912.480	
BEIERSDORF AG	10,944	97.480	1,066,821.120	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,634	51.440	752,772.960	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	20,106	51.020	1,025,808.120	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	272.550	1,413,989.400	
ORANGE	228,746	10.802	2,470,914.290	
SAMPO OYJ-A SHS	52,583	41.500	2,182,194.500	
RANDSTAD NV	11,897	50.500	600,798.500	
ALLIANZ SE	45,274	182.500	8,262,505.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	281,622	4.657	1,311,513.650	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	112,674	25.405	2,862,482.970	
HERMES INTL	3,427	1,049.000	3,594,923.000	
ENDESA S.A.	30,147	19.900	599,925.300	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	6.069	439,043.590	
ERSTE GROUP BANK AG	38,446	27.540	1,058,802.840	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	15,857	219.000	3,472,683.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,059	27.155	1,820,987.140	
DASSAULT SYSTEMES SA	75,193	36.165	2,719,354.840	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	25.320	596,817.720	
RHEINMETALL STAMM	4,693	203.000	952,679.000	
HEINEKEN NV	29,662	91.340	2,709,327.080	
AKZO NOBEL	19,812	75.420	1,494,221.040	
ASML HOLDING NV	44,828	495.100	22,194,342.800	
AEGON NV	196,332	4.597	902,538.200	
VOLKSWAGEN AG	3,315	204.000	676,260.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	20,739	152.280	3,158,134.920	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	720,570	4.310	3,105,656.700	
KERING	8,091	510.400	4,129,646.400	
ACCIONA S.A.	2,642	183.900	485,863.800	
FORTUM OYJ	43,311	16.410	710,733.510	
AGEAS	18,136	41.370	750,286.320	
UCB SA	13,322	81.360	1,083,877.920	
NEMETSCHEK SE	5,104	63.640	324,818.560	

CARREFOUR SA	64,831	18.340	1,189,000.540	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.990	477,102.230	
NOKIA OYJ	577,711	4.499	2,599,121.780	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	102,542	22.075	2,263,614.650	
WOLTERS KLUWER-CVA	28,129	88.040	2,476,477.160	
SANOFI	125,613	96.870	12,168,131.310	
STMICROELECTRONICS NV	74,365	34.505	2,565,964.320	
ELISA OYJ	14,618	52.820	772,122.760	
BANCO SANTANDER SA	1,864,329	2.700	5,033,688.300	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	18.700	916,505.700	
QIAGEN N.V.	27,412	42.360	1,161,172.320	
DEUTSCHE BANK AG-REG	226,269	9.428	2,133,264.130	
BMW VORZUG	7,821	74.200	580,318.200	
ENEL SPA	878,117	5.481	4,812,959.270	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	360,021	18.150	6,534,381.150	
SARTORIUS AG	2,847	357.700	1,018,371.900	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	45.450	501,404.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	141,467	26.645	3,769,388.210	
RATIONAL AG	516	605.000	312,180.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	120.350	585,623.100	
BECHTLE AG	8,139	39.980	325,397.220	
KONINKLIJKE KPN NV	358,749	3.307	1,186,382.940	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	83.420	1,232,864.180	
TELEPERFORMANCE	6,857	296.100	2,030,357.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,203	151.950	3,069,845.850	
EURAZEO	3,311	70.950	234,915.450	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	83.280	942,563.040	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	71.900	780,330.700	
INDITEX	116,799	22.800	2,663,017.200	
ESSILORLUXOTTICA	30,923	142.000	4,391,066.000	
SNAM SPA	210,122	5.194	1,091,373.660	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	9.229	1,326,391.880	
ENAGAS	24,864	21.710	539,797.440	
WENDEL	2,354	92.500	217,745.000	
TENARIS SA	55,855	14.800	826,654.000	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.254	230,704.640	
ATLANTIA SPA	48,155	22.510	1,083,969.050	
PROXIMUS	14,640	15.145	221,722.800	
TERNA SPA	166,064	7.510	1,247,140.640	
BIOMERIEUX	4,870	90.540	440,929.800	
GRIFOLS SA	31,982	18.245	583,511.590	
FERROVIAL SA	58,552	24.680	1,445,063.360	
NESTE OYJ	45,715	43.000	1,965,745.000	
RECORDATI SPA	10,908	37.030	403,923.240	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.250	534,418.750	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	176.200	1,058,609.600	

KONE OYJ	40,207	47.520	1,910,636.640	
ELIA GROUP	2,918	147.100	429,237.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	310.900	966,588.100	
ENGIE	206,708	12.258	2,533,826.660	
ALSTOM	30,164	25.830	779,136.120	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	8.484	551,561.800	
IPSEN SA	3,873	88.700	343,535.100	
ARKEMA SA	6,392	105.950	677,232.400	
LEGRAND SA	30,729	76.260	2,343,393.540	
AMPLIFON SPA	12,300	29.210	359,283.000	
ADP	3,975	129.300	513,967.500	
ORION OYJ	13,559	36.550	495,581.450	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	12.405	736,931.430	
SYMRISE AG	15,064	101.000	1,521,464.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,552	34.730	887,420.960	
PRYSMIAN SPA	30,728	28.550	877,284.400	
DIASORIN SPA	2,429	115.750	281,156.750	
CAIXABANK	498,058	3.220	1,603,746.760	
BUREAU VERITAS SA	31,295	26.070	815,860.650	
GETLINK	44,292	17.425	771,788.100	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	22.930	677,833.730	
AMADEUS IT GROUP SA	51,056	53.720	2,742,728.320	
BRENTAG SE	17,934	68.520	1,228,837.680	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	24.950	615,940.650	
EDENRED	26,160	44.180	1,155,748.800	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.738	288,787.810	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	87.500	718,287.500	
KION GROUP AG	7,874	42.580	335,274.920	
VONOVIA SE	78,397	32.750	2,567,501.750	
KNORR-BREMSE AG	7,195	63.760	458,753.200	
OCI NV	12,329	31.800	392,062.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	52.680	1,586,721.600	
FERRARI NV	14,074	173.650	2,443,950.100	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	12.965	1,457,097.450	
AROUNDTOWN SA	113,225	3.934	445,427.150	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,858	33.510	296,831.580	
MONCLER SPA	25,014	40.960	1,024,573.440	
NEXI SPA	58,847	8.160	480,191.520	
PROSUS NV	89,215	49.580	4,423,279.700	
JDE PEET'S BV	7,893	26.800	211,532.400	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	16.845	783,427.260	
EURONEXT NV	10,081	75.700	763,131.700	
IMCD NV	5,720	140.050	801,086.000	
WORLDLINE SA	24,912	36.850	918,007.200	
NN GROUP NV	31,214	45.620	1,423,982.680	
FINECOBANK SPA	75,180	10.900	819,462.000	

	ARGENX SE	5,297	312.300	1,654,253.100	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	82,533	20.650	1,704,306.450	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	47,088	28.440	1,339,182.720	
	ZALANDO SE	24,405	30.760	750,697.800	
	STELLANTIS NV	232,475	12.992	3,020,315.200	
	AENA SME SA	7,394	138.150	1,021,481.100	
	CELLNEX TELECOM SAU	59,261	40.760	2,415,478.360	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	21.585	489,331.950	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	10.445	551,861.570	
	EXOR NV	10,514	63.060	663,012.840	
	SCOUT24 SE	10,048	56.420	566,908.160	
	COVESTRO AG	20,258	41.560	841,922.480	
	HELLOFRESH SE	17,856	33.220	593,176.320	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	93,774	49.515	4,643,219.610	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.152	538,952.120	
	AMUNDI SA	6,292	50.700	319,004.400	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.918	415,355.920	
	ADYEN NV	2,330	1,334.600	3,109,618.000	
	UNIPER SE	11,072	21.700	240,262.400	
	DELIVERY HERO SE	17,246	38.020	655,692.920	
ユーロ 小計		20,011,686		459,168,172.750 (64,963,113,081)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	172,000	14.900	2,562,800.000	
	CLP HOLDINGS LTD	171,296	75.750	12,975,672.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	50.750	2,908,685.500	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	130,291	355.200	46,279,363.200	
	MTR CORP	192,441	41.700	8,024,789.700	
	HANG SENG BANK LTD	79,896	135.600	10,833,897.600	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	30.150	5,154,805.800	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	50.400	7,626,528.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	8.590	10,698,037.540	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	265,904	43.600	11,593,414.400	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	372,495	29.500	10,988,602.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	29.950	5,183,326.700	
	SINO LAND CO	411,200	11.120	4,572,544.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	161,065	96.000	15,462,240.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	48.600	2,576,772.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	159,156	102.700	16,345,321.200	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	18.200	3,239,600.000	

CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	14.200	3,308,600.000	
AIA GROUP LTD	1,340,316	80.900	108,431,564.400	
HKT TRUST / HKT LTD	463,136	10.720	4,964,817.920	
SANDS CHINA LTD	260,600	16.060	4,185,236.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	26.700	3,738,000.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	19.460	2,226,224.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	160,135	36.800	5,892,968.000	
ESR CAYMAN LTD	216,400	23.000	4,977,200.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	7.670	1,890,655.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	161,300	21.300	3,435,690.000	
WH GROUP LTD	931,500	5.610	5,225,715.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	53.400	16,577,763.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	221,695	52.150	11,561,394.250	
香港・ドル 小計	8,944,269		353,442,227.710 (6,079,206,317)	
合計	119,943,333		690,561,894,067 (690,561,894,067)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年6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	108,264.000	1,029,590.640	
		GOODMAN GROUP	184,374.000	3,425,668.920	
		GPT GROUP	219,223.000	947,043.360	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	891,572.120	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,708,600.080	
		STOCKLAND	259,328.000	938,767.360	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	690,016.740	
	オーストラリア・ドル 小計		2,237,752.000	9,631,259.220 (911,309,748)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	440,678.000	1,247,118.740	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,262,804.820	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	206,400.000	375,648.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	791,747.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,690,009.000	3,677,318.560 (356,883,766)	
	投資信託受益証券 合計		3,927,761	1,268,193,514 (1,268,193,514)	

投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,597.000	2,427,975.130	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	34,348.000	1,234,467.120	
		AMERICAN TOWER CORP	50,315.000	12,629,568.150	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	157,479.000	1,028,337.870	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,391.000	2,992,626.040	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,660.000	1,517,767.200	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,907.000	1,585,893.330	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	47,808.000	8,254,051.200	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	30,615.000	4,021,586.400	
		DUKE REALTY TRUST	42,490.000	2,115,152.200	
		EQUINIX INC	10,106.000	6,560,512.020	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,442,624.120	
		EQUITY RESIDENTIAL	38,369.000	2,772,160.250	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,316.000	1,981,977.560	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	14,919.000	2,490,279.480	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	63,299.000	1,622,353.370	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,467,247.600	
		INVITATION HOMES INC	63,432.000	2,289,260.880	
		IRON MOUNTAIN INC	30,120.000	1,537,324.800	
		KIMCO REALTY	73,015.000	1,507,759.750	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	1,156,508.730	
		MID AMERICA	12,263.000	2,062,146.080	
		PROLOGIS INC	81,802.000	9,590,466.480	
		PUBLIC STORAGE	16,944.000	5,209,093.920	
		REALTY INCOME CORP	66,196.000	4,366,288.160	
		REGENCY CENTERS CORP	15,613.000	952,080.740	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	11,682.000	3,802,841.460	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	35,202.000	3,564,554.520	
		SUN COMMUNITIES INC	13,572.000	2,117,367.720	
		UDR INC	34,650.000	1,550,934.000	
		VENTAS INC	42,297.000	2,226,091.110	
		VICI PROPERTIES INC	105,573.000	3,160,855.620	
	VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	507,455.440		
WELLTOWER INC	48,014.000	3,940,508.980			
WEYERHAEUSER CO	83,741.000	3,000,440.030			
WP CAREY INC	21,266.000	1,760,824.800			
アメリカ・ドル	小計	1,499,752.000	110,447,382.260 (14,910,396,604)		
イギリス・ポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	611,754.090		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	573,872.840		

	SEGRE PLC	126,044.000	1,277,455.940	
イギリス・ポンド	小計	322,247.000	2,463,082.870 (408,108,201)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	406,445.200	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	308,817.840	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	715,263.040 (75,424,488)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	309,785.900	
	GECINA SA	5,045.000	525,689.000	
	KLEPIERRE	17,716.000	360,166.280	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	810,881.850	
	WAREHOUSES DE PAUW	16,790.000	538,623.200	
ユーロ	小計	58,152.000	2,545,146.230 (360,087,289)	
香港・ドル	LINK REIT	233,616.000	16,142,865.600	
香港・ドル	小計	233,616.000	16,142,865.600 (277,657,288)	
投資証券	合計	2,136,913	16,031,673,870 (16,031,673,870)	
合計			17,299,867,384 (17,299,867,384)	

(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 603銘柄 投資証券 36銘柄	69.35 -	- -	- 2.06	73.13
イギリス・ポンド	株式 78銘柄 投資証券 3銘柄	4.52 -	- -	- 0.06	4.69
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.14	-	-	0.15
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄 投資信託受益証券 7銘柄	2.23 -	- 0.13	- -	2.41
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	3.90 -	- -	- 0.01	4.00
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	0.31 -	- 0.05	- -	0.37
スイス・フラン	株式 41銘柄	2.90	-	-	2.97
スウェーデン・クローナ	株式 48銘柄	1.05	-	-	1.07
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.78	-	-	0.80
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.05	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.23	-	-	0.23

ユーロ	株式	223銘柄	8.96	-	-	9.23
	投資証券	5銘柄	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.84	-	-	0.90
	投資証券	1銘柄	-	-	0.04	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年6月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,319,977,222
コール・ローン	1,383,175,119
国債証券	395,394,859,623
未収利息	1,269,202,883
前払費用	929,350,512
流動資産合計	404,296,565,359
資産合計	404,296,565,359
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,246,863,815
未払金	2,067,285,406
未払解約金	53,623,000
流動負債合計	17,367,772,221
負債合計	17,367,772,221
純資産の部	
元本等	
元本	306,068,649,641
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	80,860,143,497
元本等合計	386,928,793,138
純資産合計	386,928,793,138
負債純資産合計	404,296,565,359

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年12月14日 至 2022年6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礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年6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	395,213,268,647円
同期中追加設定元本額	580,479,357,303円
同期中一部解約元本額	669,623,976,309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>	7,917,290,328円
たわらノーロード バランス(堅実型)	913,974,374円
たわらノーロード バランス(標準型)	2,385,117,289円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,142,290,705円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	51,376,797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)	1,461,123,264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)	1,810,284,576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)	576,715,768円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	291,306,031円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	8,063,078円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	21,301,810円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	193,965,500円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	13,607,314円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	20,564,067円
投資のソムリエ	154,657,465,328円
投資のソムリエ<DC年金>	9,674,975,477円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,729,805,477円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	49,791,164,842円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,318,936,250円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,961,294,681円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	464,088,184円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	234,326,172円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	64,705,631円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,502,094,089円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	10,667,364,715円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,026,492,718円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	564,248,623円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	234,134,466円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	154,826,999円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	27,056,178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)	19,896,248,608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)	7,636,413,287円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	4,004,181,571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)	166,184,979円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	854,354,230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)	526,599,361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)	48,155,676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)	334,162,100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)	639,802,744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)	899,841,621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)	1,980,063,066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)	2,187,671,809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)	2,899,010,363円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	115,999,495円
計	306,068,649,641円
2. 受益権の総数	306,068,649,641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12月14日 至 2022年6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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。
-------------------	--

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	34,468,185,938	
合計	34,468,185,938	

(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2022年6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	2022年6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					
アメリカ・ドル	397,189,818,087	-	412,436,681,902	15,246,863,815	
イギリス・ポンド	198,052,422,178	-	207,900,009,025	9,847,586,847	
イスラエル・シェケル	20,578,632,113	-	21,035,841,011	457,208,898	
イスラエル・シェケル	1,617,840,339	-	1,666,455,858	48,615,519	
オーストラリア・ドル	6,176,684,412	-	6,333,049,130	156,364,718	
オフショア・人民元	7,947,027,528	-	8,241,916,475	294,888,947	
カナダ・ドル	8,235,084,794	-	8,541,604,616	306,519,822	

シンガポール・ドル	1,761,657,877	-	1,822,483,982	60,826,105
スウェーデン・クローナ	1,094,696,336	-	1,117,538,422	22,842,086
デンマーク・クローネ	1,550,953,713	-	1,592,576,629	41,622,916
ノルウェー・クローネ	851,365,626	-	860,221,756	8,856,130
ポーランド・ズロチ	1,714,673,192	-	1,751,897,216	37,224,024
マレーシア・リンギット	2,651,911,872	-	2,753,819,768	101,907,896
メキシコ・ペソ	3,198,487,556	-	3,304,944,081	106,456,525
ユーロ	141,758,380,551	-	145,514,323,933	3,755,943,382
合計	397,189,818,087	-	412,436,681,902	15,246,863,815

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年6月13日現在
1口当たり純資産額	1.2642円
(1万口当たり純資産額)	(12,642円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年6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	10,000,000.000	9,586,718.700	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,870,000.000	4,648,567.180	
		US T N/B 0.125 07/15/23	9,000,000.000	8,755,312.500	
		US T N/B 0.125 07/31/23	1,850,000.000	1,797,318.340	
		US T N/B 0.125 08/15/23	8,310,000.000	8,060,700.000	
		US T N/B 0.125 08/31/23	11,040,000.000	10,695,000.000	
		US T N/B 0.125 09/15/23	6,120,000.000	5,923,968.750	
		US T N/B 0.125 10/15/23	10,000,000.000	9,659,375.000	
		US T N/B 0.25 03/15/24	10,000,000.000	9,536,718.700	
		US T N/B 0.25 05/15/24	11,750,000.000	11,145,976.560	

US T N/B 0.25 05/31/25	8,970,000.000	8,218,762.500	
US T N/B 0.25 06/15/24	11,000,000.000	10,399,296.820	
US T N/B 0.25 06/30/25	8,990,000.000	8,214,963.640	
US T N/B 0.25 07/31/25	8,980,000.000	8,183,375.750	
US T N/B 0.25 08/31/25	9,920,000.000	9,014,024.940	
US T N/B 0.25 09/30/25	10,000,000.000	9,062,109.300	
US T N/B 0.25 10/31/25	7,500,000.000	6,778,710.900	
US T N/B 0.25 11/15/23	12,280,000.000	11,845,403.050	
US T N/B 0.375 04/15/24	7,740,000.000	7,379,606.250	
US T N/B 0.375 04/30/25	6,870,000.000	6,334,623.020	
US T N/B 0.375 07/15/24	9,000,000.000	8,508,515.580	
US T N/B 0.375 07/31/27	5,000,000.000	4,321,289.050	
US T N/B 0.375 08/15/24	10,000,000.000	9,425,781.200	
US T N/B 0.375 09/15/24	10,000,000.000	9,400,781.200	
US T N/B 0.375 09/30/27	7,670,000.000	6,597,997.610	
US T N/B 0.375 11/30/25	9,020,000.000	8,172,260.890	
US T N/B 0.375 12/31/25	8,400,000.000	7,589,531.200	
US T N/B 0.5 02/28/26	10,350,000.000	9,351,790.930	
US T N/B 0.5 03/31/25	9,000,000.000	8,351,718.750	
US T N/B 0.5 04/30/27	5,560,000.000	4,870,646.840	
US T N/B 0.5 05/31/27	4,830,000.000	4,219,080.440	
US T N/B 0.5 06/30/27	5,170,000.000	4,505,978.120	
US T N/B 0.5 08/31/27	9,520,000.000	8,261,203.050	
US T N/B 0.5 10/31/27	6,000,000.000	5,183,203.080	
US T N/B 0.5 11/30/23	2,000,000.000	1,932,968.740	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,630,000.000	2,323,646.080	
US T N/B 0.625 05/15/30	12,420,000.000	10,207,687.500	
US T N/B 0.625 07/31/26	8,000,000.000	7,185,624.960	
US T N/B 0.625 08/15/30	18,280,000.000	14,938,187.500	
US T N/B 0.625 10/15/24	10,000,000.000	9,439,062.500	
US T N/B 0.625 11/30/27	8,510,000.000	7,391,732.810	
US T N/B 0.625 12/31/27	10,160,000.000	8,799,115.650	
US T N/B 0.75 01/31/28	10,270,000.000	8,950,946.870	
US T N/B 0.75 03/31/26	10,640,000.000	9,688,218.690	
US T N/B 0.75 04/30/26	8,290,000.000	7,529,651.560	
US T N/B 0.75 05/31/26	7,000,000.000	6,344,843.750	
US T N/B 0.75 08/31/26	10,000,000.000	9,010,156.200	
US T N/B 0.75 11/15/24	4,040,000.000	3,814,643.750	
US T N/B 0.75 12/31/23	4,940,000.000	4,780,607.780	
US T N/B 0.875 01/31/24	6,000,000.000	5,805,937.500	
US T N/B 0.875 06/30/26	6,250,000.000	5,682,861.310	
US T N/B 0.875 11/15/30	18,710,000.000	15,569,497.120	
US T N/B 1.0 07/31/28	10,670,000.000	9,322,912.500	
US T N/B 1.0 12/15/24	9,760,000.000	9,255,606.220	
US T N/B 1.125 01/15/25	2,940,000.000	2,790,932.790	
US T N/B 1.125 02/15/31	14,250,000.000	12,070,195.310	
US T N/B 1.125 02/28/25	4,820,000.000	4,563,560.910	
US T N/B 1.125 02/28/27	3,840,000.000	3,482,549.980	
US T N/B 1.125 02/29/28	12,380,000.000	11,008,528.120	

US T N/B 1.125 05/15/40	5,610,000.000	3,869,585.120	
US T N/B 1.125 08/15/40	6,760,000.000	4,633,240.590	
US T N/B 1.125 08/31/28	9,870,000.000	8,685,214.370	
US T N/B 1.25 03/31/28	6,880,000.000	6,152,225.000	
US T N/B 1.25 04/30/28	11,000,000.000	9,814,062.500	
US T N/B 1.25 05/15/50	9,150,000.000	5,765,036.090	
US T N/B 1.25 05/31/28	10,850,000.000	9,667,095.670	
US T N/B 1.25 06/30/28	10,000,000.000	8,898,437.500	
US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,266,781.200	
US T N/B 1.25 08/15/31	17,690,000.000	15,013,005.380	
US T N/B 1.25 08/31/24	5,400,000.000	5,188,218.750	
US T N/B 1.25 09/30/28	10,000,000.000	8,860,546.800	
US T N/B 1.25 12/31/26	9,100,000.000	8,326,855.440	
US T N/B 1.375 08/15/50	11,760,000.000	7,662,374.990	
US T N/B 1.375 08/31/23	7,880,000.000	7,747,025.000	
US T N/B 1.375 08/31/26	4,750,000.000	4,397,460.930	
US T N/B 1.375 10/31/28	7,000,000.000	6,243,671.840	
US T N/B 1.375 11/15/31	20,420,000.000	17,463,885.830	
US T N/B 1.375 11/15/40	10,970,000.000	7,845,264.050	
US T N/B 1.375 12/31/28	6,900,000.000	6,149,625.000	
US T N/B 1.5 01/31/27	13,290,000.000	12,284,943.750	
US T N/B 1.5 02/15/25	9,580,000.000	9,162,746.060	
US T N/B 1.5 02/15/30	8,730,000.000	7,732,870.310	
US T N/B 1.5 02/29/24	8,520,000.000	8,309,662.500	
US T N/B 1.5 08/15/26	7,990,000.000	7,431,636.260	
US T N/B 1.5 09/30/24	6,490,000.000	6,254,230.430	
US T N/B 1.5 10/31/24	8,000,000.000	7,696,874.960	
US T N/B 1.5 11/30/24	7,100,000.000	6,820,437.500	
US T N/B 1.5 11/30/28	7,000,000.000	6,286,328.090	
US T N/B 1.625 02/15/26	7,900,000.000	7,456,550.720	
US T N/B 1.625 05/15/26	10,000,000.000	9,394,140.600	
US T N/B 1.625 05/15/31	14,320,000.000	12,617,262.500	
US T N/B 1.625 05/31/23	5,460,000.000	5,410,092.160	
US T N/B 1.625 08/15/29	8,400,000.000	7,554,750.000	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,571,103.120	
US T N/B 1.625 10/31/26	5,100,000.000	4,756,746.080	
US T N/B 1.625 11/15/50	8,770,000.000	6,109,538.230	
US T N/B 1.625 11/30/26	5,310,000.000	4,951,160.120	
US T N/B 1.75 01/31/29	10,000,000.000	9,116,406.200	
US T N/B 1.75 03/15/25	6,100,000.000	5,867,437.500	
US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	6,585,718.750	
US T N/B 1.75 07/31/24	8,000,000.000	7,783,124.960	
US T N/B 1.75 08/15/41	14,040,000.000	10,626,525.000	
US T N/B 1.75 11/15/29	6,900,000.000	6,252,046.870	
US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	4,673,446.870	
US T N/B 1.875 02/15/32	13,520,000.000	12,080,331.180	
US T N/B 1.875 02/15/41	6,540,000.000	5,104,265.620	
US T N/B 1.875 02/15/51	15,740,000.000	11,693,098.340	
US T N/B 1.875 02/28/27	6,690,000.000	6,288,077.310	

US T N/B 1.875 02/28/29	10,000,000.000	9,191,015.600	
US T N/B 1.875 06/30/26	4,920,000.000	4,663,237.500	
US T N/B 1.875 07/31/26	5,000,000.000	4,733,007.800	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,030,000.000	6,847,659.370	
US T N/B 1.875 11/15/51	11,990,000.000	8,909,131.960	
US T N/B 2.0 02/15/25	9,000,000.000	8,730,703.080	
US T N/B 2.0 02/15/50	8,510,000.000	6,537,740.940	
US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	6,734,590.610	
US T N/B 2.0 05/31/24	8,440,000.000	8,275,156.240	
US T N/B 2.0 06/30/24	6,710,000.000	6,573,178.870	
US T N/B 2.0 08/15/25	10,000,000.000	9,629,687.500	
US T N/B 2.0 08/15/51	15,110,000.000	11,568,593.750	
US T N/B 2.0 11/15/26	10,580,000.000	10,019,177.260	
US T N/B 2.0 11/15/41	6,400,000.000	5,063,000.000	
US T N/B 2.125 02/29/24	5,000,000.000	4,930,078.100	
US T N/B 2.125 03/31/24	10,900,000.000	10,745,867.130	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,000,000.000	9,701,562.500	
US T N/B 2.125 05/31/26	5,000,000.000	4,789,257.800	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	6,052,384.370	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,400,000.000	2,349,562.480	
US T N/B 2.125 11/30/23	8,000,000.000	7,919,374.960	
US T N/B 2.125 11/30/24	6,670,000.000	6,512,108.550	
US T N/B 2.25 01/31/24	6,160,000.000	6,097,437.490	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,770,000.000	8,378,433.180	
US T N/B 2.25 02/15/52	15,500,000.000	12,647,031.240	
US T N/B 2.25 03/31/24	2,510,000.000	2,475,389.430	
US T N/B 2.25 03/31/26	7,000,000.000	6,747,343.750	
US T N/B 2.25 04/30/24	5,000,000.000	4,931,640.600	
US T N/B 2.25 05/15/41	5,460,000.000	4,527,107.780	
US T N/B 2.25 08/15/27	6,190,000.000	5,886,786.680	
US T N/B 2.25 08/15/46	5,510,000.000	4,421,344.500	
US T N/B 2.25 08/15/49	7,430,000.000	6,053,708.550	
US T N/B 2.25 10/31/24	6,560,000.000	6,428,800.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,000,000.000	9,794,140.600	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,560,000.000	7,317,253.080	
US T N/B 2.25 11/15/27	8,040,000.000	7,632,346.830	
US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	7,924,374.960	
US T N/B 2.25 12/31/24	7,210,000.000	7,050,028.120	
US T N/B 2.375 02/15/42	9,980,000.000	8,419,845.260	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,741,546.840	
US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,143,407.780	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,000,000.000	4,794,726.550	
US T N/B 2.375 05/15/29	9,450,000.000	8,946,122.960	
US T N/B 2.375 05/15/51	13,620,000.000	11,401,429.610	
US T N/B 2.375 08/15/24	4,000,000.000	3,940,000.000	
US T N/B 2.375 11/15/49	3,120,000.000	2,615,803.100	
US T N/B 2.5 01/31/24	10,000,000.000	9,929,687.500	
US T N/B 2.5 01/31/25	6,000,000.000	5,896,406.220	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,440,000.000	3,748,331.250	

US T N/B 2.5 02/15/46	5,270,000.000	4,453,561.680	
US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,372,512.500	
US T N/B 2.5 03/31/27	9,400,000.000	9,086,788.990	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,050,000.000	8,963,035.110	
US T N/B 2.5 05/15/46	360,000.000	303,996.090	
US T N/B 2.5 08/15/23	5,000,000.000	4,987,500.000	
US T N/B 2.625 01/31/26	1,280,000.000	1,252,000.000	
US T N/B 2.625 02/15/29	7,530,000.000	7,252,625.360	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,364,242.180	
US T N/B 2.625 04/15/25	2,280,000.000	2,244,018.750	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,000,000.000	1,958,281.240	
US T N/B 2.75 02/15/24	3,470,000.000	3,459,156.250	
US T N/B 2.75 02/15/28	9,000,000.000	8,762,695.290	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,219,728.870	
US T N/B 2.75 05/31/23	7,220,000.000	7,231,281.250	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,150,000.000	1,134,187.500	
US T N/B 2.75 07/31/23	8,860,000.000	8,866,229.640	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,000,000.000	2,678,906.250	
US T N/B 2.75 08/15/47	4,900,000.000	4,367,890.620	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,036,041.370	
US T N/B 2.75 08/31/25	3,000,000.000	2,953,828.110	
US T N/B 2.75 11/15/23	2,500,000.000	2,496,679.670	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,920,000.000	4,383,412.500	
US T N/B 2.75 11/15/47	4,880,000.000	4,352,731.220	
US T N/B 2.875 04/30/25	3,920,000.000	3,884,781.220	
US T N/B 2.875 05/15/28	11,000,000.000	10,770,546.820	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,820,000.000	3,466,351.540	
US T N/B 2.875 05/15/49	4,730,000.000	4,386,705.440	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,508,054.680	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,270,000.000	3,233,723.430	
US T N/B 2.875 08/15/28	8,860,000.000	8,664,803.120	
US T N/B 2.875 08/15/45	2,400,000.000	2,171,437.480	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	7,822,203.120	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,030,000.000	3,660,373.430	
US T N/B 2.875 11/30/23	8,670,000.000	8,669,322.600	
US T N/B 2.875 11/30/25	4,140,000.000	4,087,603.120	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,430,000.000	5,990,449.180	
US T N/B 3.0 02/15/48	5,830,000.000	5,472,456.990	
US T N/B 3.0 02/15/49	5,450,000.000	5,163,875.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,270,000.000	3,049,275.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,930,000.000	1,783,742.180	
US T N/B 3.0 05/15/47	2,810,000.000	2,618,349.200	
US T N/B 3.0 08/15/48	9,070,000.000	8,532,177.290	
US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,983,828.120	
US T N/B 3.0 10/31/25	3,620,000.000	3,590,870.280	
US T N/B 3.0 11/15/44	40,000.000	36,912.500	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,370,000.000	3,118,303.120	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,310,000.000	1,247,365.620	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,760,000.000	2,612,512.500	

US T N/B 3.125 05/15/48	5,440,000.000	5,240,250.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	3,650,000.000	3,444,972.630	
US T N/B 3.125 11/15/28	7,380,000.000	7,317,154.650	
US T N/B 3.125 11/15/41	80,000.000	76,231.240	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,580,000.000	3,519,587.500	
US T N/B 3.375 11/15/48	5,050,000.000	5,110,363.250	
US T N/B 3.5 02/15/39	890,000.000	917,673.430	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,660,000.000	5,787,792.150	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,000,000.000	4,087,500.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,000,000.000	3,123,281.250	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,500,000.000	5,726,445.280	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	2,753,142.170	
US T N/B 4.25 05/15/39	2,000,000.000	2,255,468.740	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,320,000.000	3,709,321.850	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,890,000.000	2,166,855.440	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,770,000.000	3,159,098.430	
US T N/B 4.375 05/15/41	870,000.000	985,275.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,370,062.500	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,410,000.000	1,639,235.140	
US T N/B 4.5 05/15/38	2,140,000.000	2,487,917.170	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	2,916,110.120	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	3,286,096.870	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,470,000.000	2,939,492.940	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,450,000.000	1,767,753.890	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	1,896,031.250	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	2,668,028.890	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	1,980,535.920	
US T N/B 6.125 11/15/27	3,000,000.000	3,418,359.360	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,426,093.700	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,390,000.000	2,487,840.620	
アメリカ・ドル 小計	1,622,490,000.000 (219,036,150,000)	1,490,149,025.010 (201,170,118,377)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,740,000.000	1,621,506.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	5,940,000.000	5,757,345.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,790,000.000	1,597,702.440
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	960,000.000	912,048.000
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,680,000.000	1,385,268.190
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	3,340,000.000	3,087,476.620
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	2,240,000.000	1,915,783.290
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,550,000.000	1,380,740.030
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,810,000.000	945,144.340

UK TREASURY 0.625 06/07/25	2,110,000.000	2,023,131.300	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,920,000.000	2,282,184.400	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,430,000.000	881,812.360	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	3,400,000.000	3,356,154.960	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	2,970,000.000	2,080,188.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,560,000.000	2,157,853.690	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	3,120,000.000	2,832,151.290	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	770,000.000	673,964.830	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	2,490,000.000	2,443,731.810	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,360,000.000	1,087,404.040	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	1,110,000.000	721,049.780	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,000,000.000	1,915,892.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,270,000.000	932,612.560	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,590,000.000	2,056,466.210	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,780,000.000	2,713,502.400	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,980,000.000	2,385,597.280	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	670,000.000	523,692.100	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,320,000.000	1,278,420.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	2,120,000.000	1,706,875.600	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	2,440,000.000	1,941,060.010	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	1,300,000.000	1,095,759.600	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	2,210,000.000	1,839,825.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	3,760,000.000	3,354,455.420	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,800,000.000	1,793,898.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	910,000.000	912,350.160	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,150,000.000	2,222,584.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,027,400.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,080,000.000	3,397,948.400	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,230,000.000	4,861,792.800	

	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,970,000.000	2,587,929.900	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,160,000.000	2,710,692.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,340,000.000	3,248,177.400	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,120,000.000	2,530,224.240	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,960,000.000	3,435,808.160	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,720,000.000	2,112,349.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,000,000.000	3,318,486.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,190,000.000	1,473,486.560	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,060,000.000	2,670,069.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,280,000.000	3,026,084.400	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,170,000.000	4,428,743.600	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,010,000.000	3,902,344.600	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,500,000.000	2,976,575.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,060,000.000	2,655,125.760	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,270,000.000	2,439,576.710	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	1,780,382.500	
	イギリス・ボンド 小計	121,160,000.000 (20,075,000,400)	121,398,826.940 (20,114,571,636)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	5,490,000.000	5,239,837.170	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	3,170,000.000	2,930,626.960	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	4,380,000.000	4,142,779.200	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,810,000.000	2,444,236.350	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	2,690,000.000	2,304,609.080	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,370,000.000	1,069,963.150	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	1,630,000.000	1,624,091.250	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,330,000.000	2,273,544.100	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	360,000.000	348,606.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,620,000.000	1,566,601.560	

	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	3,360,000.000	3,455,239.200	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	5,110,000.000	5,198,786.250	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	2,330,000.000	2,985,820.440	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	3,700,000.000	4,237,761.700	
イスラエル・シュケル 小計		40,350,000.000 (1,605,954,210)	39,822,502.410 (1,584,959,489)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	4,500,000.000	4,218,896.780	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	3,500,000.000	3,161,858.170	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	3,290,000.000	2,923,036.750	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	3,470,000.000	2,737,845.090	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	4,210,000.000	3,400,514.080	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	3,220,000.000	2,575,695.960	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,320,000.000	1,938,130.830	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	810,000.000	490,941.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,190,000.000	1,824,039.080	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,000,000.000	1,858,100.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	4,540,000.000	4,193,426.290	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	2,100,000.000	2,099,920.950	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,890,000.000	1,585,842.560	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,140,000.000	1,018,561.550	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,120,000.000	2,039,228.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	950,000.000	909,034.310	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,060,000.000	1,934,134.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	3,690,000.000	3,115,972.080	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	3,000,000.000	2,800,296.480	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,440,000.000	1,445,251.390	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,500,000.000	3,438,384.480		
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	3,270,000.000	3,003,076.240		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,830,000.000	1,809,277.740		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,170,000.000	3,280,616.190		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,290,000.000	3,525,593.280		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,760,000.000	2,931,909.360		
オーストラリア・ドル 小計		70,260,000.000 (6,648,001,200)	64,259,582.640 (6,080,241,709)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	52,000,000.000	51,887,940.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	25,000,000.000	25,016,500.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	25,000,000.000	24,797,000.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	34,000,000.000	34,127,962.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	10,000,000.000	9,968,100.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	18,600,000.000	18,696,132.240	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	23,500,000.000	23,193,451.660	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	56,500,000.000	56,817,247.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	17,000,000.000	16,938,035.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	18,000,000.000	18,035,640.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	15,500,000.000	15,639,655.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	22,000,000.000	22,358,600.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	21,500,000.000	21,816,658.450	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	23,500,000.000	24,270,619.050	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	24,400,000.000	25,378,806.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	12,950,000.000	13,869,799.650	
	オフショア・人民元 小計	399,450,000.000 (7,973,501,340)	402,812,146.950 (8,040,613,828)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	2,200,000.000	1,968,205.800	
	CANADA 0.25 04/01/24	2,600,000.000	2,467,056.800	
	CANADA 0.25 08/01/23	810,000.000	784,538.460	
	CANADA 0.5 09/01/25	3,990,000.000	3,661,623.000	
	CANADA 0.5 11/01/23	3,490,000.000	3,365,005.650	
	CANADA 0.5 12/01/30	4,500,000.000	3,554,563.500	
	CANADA 0.75 02/01/24	4,010,000.000	3,854,432.050	
	CANADA 0.75 10/01/24	3,250,000.000	3,072,397.250	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,610,000.000	1,440,813.150	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,660,000.000	1,510,286.260	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,200,000.000	2,086,849.600	
	CANADA 1.25 03/01/27	2,380,000.000	2,165,438.240	
	CANADA 1.25 06/01/30	6,590,000.000	5,623,510.600	
	CANADA 1.5 04/01/25	2,080,000.000	1,981,570.240	
	CANADA 1.5 05/01/24	1,000,000.000	968,465.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,110,000.000	1,093,771.800	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,900,000.000	1,775,565.200	
	CANADA 1.5 06/01/31	7,200,000.000	6,170,781.600	
	CANADA 1.5 09/01/24	800,000.000	770,657.600	
	CANADA 1.5 12/01/31	4,310,000.000	3,670,102.920	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,650,000.000	1,900,643.600	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,500,000.000	1,329,910.500	
	CANADA 2.0 09/01/23	2,220,000.000	2,190,387.420	
	CANADA 2.0 12/01/51	7,920,000.000	6,126,967.440	
	CANADA 2.25 03/01/24	2,400,000.000	2,363,073.600	

	CANADA 2.25 06/01/25	1,260,000.000	1,225,350.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	1,782,049.100	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,090,000.000	1,075,336.230	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,120,000.000	1,026,428.480	
	CANADA 2.75 12/01/64	780,000.000	701,183.340	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,920,000.000	1,993,656.960	
	CANADA 4.0 06/01/41	600,000.000	658,876.200	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,190,000.000	1,423,439.920	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,440,000.000	1,654,922.880	
カナダ・ドル 小計		85,690,000.000 (9,036,010,500)	77,437,860.390 (8,165,822,378)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	610,000.000	569,191.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	830,000.000	781,528.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	400,000.000	359,359.490	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	770,000.000	622,160.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	400,000.000	327,064.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	750,000.000	747,506.250	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	1,380,000.000	1,353,090.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	1,120,000.000	1,019,541.600	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	1,140,000.000	1,135,326.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	260,000.000	237,380.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,180,000.000	1,171,150.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,100,000.000	1,054,350.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,160,000.000	1,111,877.400	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	660,000.000	663,784.830	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,330,000.000	1,333,325.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,200,000.000	1,196,400.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,050,000.000	1,063,335.000	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,600,000.000	1,655,200.000		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,430,000.000	1,479,349.300		
シンガポール・ドル 小計		18,370,000.000 (1,782,808,500)	17,880,917.870 (1,735,343,079)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	6,650,000.000	5,753,014.350	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	12,680,000.000	11,934,276.520	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	4,810,000.000	4,466,727.610	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	21,800,000.000	21,066,467.050	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	5,230,000.000	5,235,569.950	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	7,530,000.000	7,838,955.900	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	16,220,000.000	16,560,538.900	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,290,000.000	7,698,802.750	
スウェーデン・クローナ 小計		81,210,000.000 (1,089,838,200)	80,554,353.030 (1,081,039,418)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	11,030,000.000	10,711,674.200	
	DENMARK 0.0 11/15/31	8,860,000.000	7,471,510.920	
	DENMARK 0.25 11/15/52	7,060,000.000	4,378,364.900	
	DENMARK 0.5 11/15/27	5,450,000.000	5,128,997.170	

	DENMARK 0.5 11/15/29	18,520,000.000	16,939,503.200	
	DENMARK 1.5 11/15/23	3,600,000.000	3,638,156.400	
	DENMARK 1.75 11/15/25	6,330,000.000	6,406,166.350	
	DENMARK 4.5 11/15/39	18,120,000.000	24,880,263.960	
デンマーク・クローネ 小計		78,970,000.000 (1,502,009,400)	79,554,637.100 (1,513,129,198)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,450,000.000	2,098,449.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	8,130,000.000	7,158,871.500	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,220,000.000	4,002,556.060	
	NORWAY 1.75 02/17/27	9,840,000.000	9,303,021.360	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,250,000.000	1,211,600.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	5,720,000.000	5,244,107.440	
	NORWAY 2.0 04/26/28	13,360,000.000	12,640,564.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	5,560,000.000	5,120,760.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	12,770,000.000	12,850,675.740	
ノルウェー・クローネ 小計		63,300,000.000 (874,806,000)	59,630,605.600 (824,094,969)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,100,000.000	819,225.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	8,370,000.000	7,053,817.500	
	POLAND 07/25/24	2,220,000.000	1,921,182.420	
	POLAND 1.25 10/25/30	6,690,000.000	4,286,952.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	2,200,000.000	1,407,010.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	4,690,000.000	4,234,835.500	
	POLAND 2.5 04/25/24	7,510,000.000	6,945,698.600	
	POLAND 2.5 07/25/26	9,000,000.000	7,495,200.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	6,690,000.000	5,338,787.250	
	POLAND 2.75 04/25/28	11,010,000.000	8,716,066.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	3,290,492.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,440,000.000	2,176,846.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	1,070,000.000	1,034,610.820	
ポーランド・ズロチ 小計		67,350,000.000 (2,066,459,640)	54,720,723.590 (1,678,963,129)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,090,000.000	1,843,876.040	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,830,000.000	1,842,999.770	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	200,000.000	196,703.160	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	5,090,000.000	5,012,707.720	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	3,750,000.000	3,296,498.210	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	1,070,000.000	1,082,406.860	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,860,000.000	1,740,039.690	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	3,510,000.000	3,337,610.630	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	3,910,000.000	3,843,740.970	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,373,208.540	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	2,000,000.000	1,996,299.800	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	3,090,000.000	3,107,577.460	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,810,000.000	1,821,870.700	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,750,000.000	4,804,027.920		

	MALAYSIA 4.059 09/30/24	1,920,000.000	1,955,131.770	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	4,520,000.000	3,929,669.550	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	3,500,000.000	3,572,789.500	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	4,200,000.000	4,190,653.690	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,370,000.000	1,331,903.510	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	2,030,000.000	2,080,400.430	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	3,050,000.000	3,107,759.980	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	920,000.000	920,663.500	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	1,480,000.000	1,449,002.990	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,640,000.000	3,696,727.580	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,030,000.000	1,051,817.870	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,400,000.000	2,402,006.640	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	580,000.000	584,553.170	
マレーシア・リングット 小計		66,970,000.000 (2,049,456,122)	65,572,647.650 (2,006,693,507)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	20,000,000.000	17,210,800.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	19,510,000.000	17,506,781.680	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	55,000,000.000	55,841,137.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	63,554,000.000	56,590,313.210	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	54,445,000.000	51,036,393.440	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	63,290,000.000	58,647,045.600	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	24,328,000.000	21,329,087.440	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,011,000.000	14,570,810.550	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	38,590,000.000	37,592,448.500	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	37,956,000.000	33,906,902.120	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	47,501,000.000	46,262,218.540	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	46,353,000.000	44,363,544.060	
	メキシコ・ペソ 小計		486,538,000.000 (3,272,746,511)	454,857,482.140 (3,059,644,339)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	2,760,000.000	2,395,431.600	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,000,000.000	845,865.100	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	890,000.000	859,633.200	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	1,540,000.000	1,173,942.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	3,200,000.000	2,945,385.600	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	4,010,000.000	3,818,927.510	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	130,000.000	68,591.640	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,930,000.000	1,836,095.850	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	740,000.000	512,759.320	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,230,000.000	3,128,322.830	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	390,000.000	169,791.960	

AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,500,000.000	1,351,998.000	
AUSTRIA 07/15/24	20,000.000	19,611.620	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	500,000.000	498,435.000	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	490,000.000	429,050.370	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	400,000.000	276,800.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	3,600,000.000	3,653,654.400	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	3,280,000.000	3,331,076.160	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	970,000.000	826,483.490	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,660,000.000	1,720,261.320	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	920,000.000	1,087,229.320	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	1,790,000.000	2,489,571.380	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	2,360,000.000	2,967,464.000	
BELGIUM 0.0 10/22/27	800,000.000	734,632.000	
BELGIUM 0.0 10/22/31	3,190,000.000	2,637,811.000	
BELGIUM 0.1 06/22/30	3,100,000.000	2,689,250.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	70,000.000	69,685.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	1,120,000.000	790,858.120	
BELGIUM 0.5 10/22/24	5,100,000.000	5,028,426.600	
BELGIUM 0.65 06/22/71	1,040,000.000	478,577.340	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,750,000.000	2,708,761.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	3,830,000.000	3,683,464.200	
BELGIUM 0.8 06/22/28	2,000,000.000	1,916,200.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	2,400,000.000	2,260,612.800	
BELGIUM 1.0 06/22/26	3,000,000.000	2,947,617.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	2,110,000.000	1,939,849.600	
BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,212,836.000	
BELGIUM 1.4 06/22/53	160,000.000	119,752.320	
BELGIUM 1.45 06/22/37	310,000.000	276,058.410	
BELGIUM 1.6 06/22/47	630,000.000	521,137.440	
BELGIUM 1.7 06/22/50	2,650,000.000	2,200,904.500	
BELGIUM 1.9 06/22/38	2,120,000.000	1,996,105.080	
BELGIUM 2.15 06/22/66	740,000.000	664,372.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	870,000.000	804,559.470	
BELGIUM 2.6 06/22/24	850,000.000	877,358.950	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,540,000.000	1,669,021.200	
BELGIUM 3.75 06/22/45	2,440,000.000	2,972,410.440	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,950,000.000	2,285,635.950	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,860,000.000	2,353,260.840	
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,300,000.000	2,566,643.600	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,430,000.000	4,483,298.120	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,140,000.000	2,604,835.820	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,100,000.000	2,963,662.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	4,620,000.000	4,483,081.680	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,000,000.000	1,878,722.000	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	3,720,000.000	3,526,746.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,000,000.000	1,931,040.000	
BUNDESOBL 04/05/24	3,490,000.000	3,439,695.140	
BUNDESOBL 10/13/23	3,940,000.000	3,914,705.200	
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,930,000.000	1,904,138.000	

BUNDESSCHAT 0.0 09/15/23	3,000,000.000	2,980,680.000	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	2,080,000.000	2,063,062.560	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	3,490,000.000	3,137,963.700	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	3,300,000.000	2,917,431.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	6,510,000.000	5,641,318.620	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	90,000.000	73,247.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	4,350,000.000	3,480,087.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	5,000,000.000	4,460,400.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	820,000.000	731,874.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	5,610,000.000	4,913,294.100	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,000,000.000	877,734.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,660,000.000	2,328,879.960	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,370,000.000	1,511,633.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,950,000.000	1,192,210.500	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	4,500,000.000	4,192,515.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	3,000,000.000	2,752,002.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	4,650,000.000	4,442,935.500	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	5,540,000.000	5,149,834.420	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	3,500,000.000	3,271,205.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	4,330,000.000	4,269,596.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	6,490,000.000	6,338,393.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	4,470,000.000	4,264,961.100	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	5,000,000.000	4,797,440.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,680,000.000	3,499,713.120	
DEUTSCHLAND 08/15/29	3,930,000.000	3,562,277.760	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	6,600,000.000	6,605,940.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	6,640,000.000	6,618,154.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	5,710,000.000	5,286,295.160	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	4,280,000.000	4,332,352.960	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	3,000,000.000	3,050,211.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,730,000.000	3,799,780.840	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	4,840,000.000	5,647,650.800	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	4,590,000.000	5,435,115.390	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,740,000.000	3,498,404.600	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,600,000.000	6,036,189.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,990,000.000	2,763,194.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,000,000.000	2,394,680.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,150,000.000	4,269,793.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,810,000.000	4,169,534.200	

DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	3,340,000.000	4,430,476.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,200,000.000	2,704,944.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,283,509.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	2,930,000.000	3,941,201.600	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,093,428.500	
FINLAND 0.0 09/15/24	100,000.000	97,729.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	880,000.000	754,240.080	
FINLAND 0.125 04/15/36	180,000.000	137,032.920	
FINLAND 0.125 04/15/52	520,000.000	290,049.240	
FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	152,296.560	
FINLAND 0.25 09/15/40	1,020,000.000	727,744.500	
FINLAND 0.5 04/15/26	2,900,000.000	2,799,813.700	
FINLAND 0.5 04/15/43	100,000.000	71,178.100	
FINLAND 0.5 09/15/27	10,000.000	9,457.630	
FINLAND 0.5 09/15/28	90,000.000	83,494.350	
FINLAND 0.5 09/15/29	1,060,000.000	967,680.360	
FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	889,564.620	
FINLAND 1.125 04/15/34	1,900,000.000	1,706,488.800	
FINLAND 1.375 04/15/47	330,000.000	283,765.350	
FINLAND 2.0 04/15/24	3,460,000.000	3,531,696.390	
FINLAND 2.625 07/04/42	1,720,000.000	1,831,800.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	160,000.000	170,062.080	
FINLAND 4.0 07/04/25	290,000.000	314,189.190	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	5,000,000.000	4,933,515.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	3,500,000.000	3,381,444.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	8,050,000.000	7,638,942.850	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	1,640,000.000	1,522,492.360	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	1,200,000.000	976,800.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	6,760,000.000	5,907,564.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	9,180,000.000	7,809,214.860	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	7,570,000.000	6,269,928.200	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	7,530,000.000	7,114,080.450	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	7,760,000.000	7,590,381.920	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	6,220,000.000	5,989,853.780	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	13,600,000.000	12,485,004.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,270,000.000	1,653,869.790	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	1,510,000.000	652,486.100	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	4,080,000.000	2,764,909.920	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,900,000.000	5,591,135.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,610,000.000	2,310,226.720	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,420,000.000	1,512,952.540	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	9,010,000.000	8,474,968.180	
FRANCE OAT 03/25/24	2,000,000.000	1,969,073.500	
FRANCE OAT 03/25/25	2,310,000.000	2,232,298.530	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	8,000,000.000	7,775,728.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	6,200,000.000	6,123,461.000	

FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,300,000.000	2,978,418.300	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	5,240,000.000	4,614,868.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,160,000.000	996,324.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	9,910,000.000	9,559,384.200	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	5,420,000.000	4,404,487.120	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,930,000.000	1,542,899.900	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	5,750,000.000	5,323,810.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	6,990,000.000	7,091,641.590	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	4,280,000.000	3,937,933.840	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	6,880,000.000	7,046,819.360	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	8,620,000.000	9,055,663.420	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	6,390,000.000	6,762,984.300	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	4,690,000.000	5,383,791.700	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,430,000.000	6,929,932.500	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	4,040,000.000	5,355,828.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,110,000.000	4,206,427.390	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,530,000.000	4,361,254.990	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	8,000,000.000	8,395,528.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,040,000.000	6,646,595.760	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,900,000.000	6,314,512.400	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,460,000.000	5,539,400.280	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	7,690,000.000	10,322,717.640	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,320,000.000	7,290,176.880	
IRISH 0.0 10/18/31	930,000.000	768,310.200	
IRISH 0.2 10/18/30	1,660,000.000	1,439,593.500	
IRISH 0.4 05/15/35	3,670,000.000	2,926,336.890	
IRISH 0.55 04/22/41	50,000.000	36,252.000	
IRISH 0.9 05/15/28	100,000.000	95,435.300	
IRISH 1.0 05/15/26	4,980,000.000	4,910,807.880	
IRISH 1.1 05/15/29	420,000.000	402,287.340	
IRISH 1.3 05/15/33	70,000.000	64,123.850	
IRISH 1.35 03/18/31	1,420,000.000	1,353,227.340	
IRISH 1.5 05/15/50	80,000.000	64,365.520	
IRISH 1.7 05/15/37	330,000.000	307,830.600	
IRISH 2.0 02/18/45	2,460,000.000	2,290,058.280	
IRISH 2.4 05/15/30	2,610,000.000	2,726,223.300	
IRISH 3.4 03/18/24	60,000.000	62,663.370	
IRISH 5.4 03/13/25	1,170,000.000	1,303,826.940	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,850,000.000	1,802,862.000	
ITALY BTPS 0.0 01/30/24	3,000,000.000	2,925,930.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	3,420,000.000	3,083,130.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,000,000.000	1,779,800.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,000,000.000	957,300.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	3,000,000.000	2,830,650.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	4,610,000.000	3,918,961.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	3,710,000.000	3,676,461.600	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	2,810,000.000	2,670,834.750	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	5,000,000.000	4,149,000.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	4,100,000.000	3,793,115.000	

ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,500,000.000	1,281,300.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	3,500,000.000	3,490,340.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	3,000,000.000	2,296,395.630	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	3,840,000.000	3,807,279.360	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	3,000,000.000	2,738,400.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	3,770,000.000	3,007,249.830	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	2,210,000.000	1,509,209.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	3,250,000.000	2,509,000.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	5,750,000.000	4,712,700.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	2,000,000.000	1,800,000.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	70,000.000	54,901.700	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	2,000,000.000	1,829,900.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,020,000.000	2,819,647.160	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	4,000,000.000	3,430,992.000	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	2,050,000.000	1,539,550.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	5,490,000.000	5,334,803.190	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,000,000.000	980,833.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	2,130,000.000	1,375,341.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	5,910,000.000	5,751,103.740	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,790,000.000	3,632,715.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	30,000.000	25,143.540	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	3,660,000.000	3,153,584.100	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	3,660,000.000	2,283,927.840	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,000,000.000	994,970.000	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	3,570,000.000	2,581,110.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,800,000.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	3,250,000.000	3,184,675.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	4,200,000.000	3,974,892.600	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	3,610,000.000	3,539,171.800	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	3,000,000.000	2,864,166.000	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	3,540,000.000	3,446,866.140	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	876,990.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,180,000.000	817,740.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,060,000.000	1,990,578.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,260,000.000	1,874,896.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,960,000.000	2,609,296.240	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,770,000.000	1,330,155.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	1,240,000.000	1,257,972.560	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,000,000.000	2,991,474.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,090,000.000	4,115,497.060	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	4,150,000.000	3,405,490.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,440,000.000	1,120,176.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	4,660,000.000	4,553,943.060	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,240,000.000	2,004,128.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,790,000.000	4,691,536.760	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	2,770,000.000	2,487,919.820	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,940,000.000	1,756,448.840	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	3,000,000.000	2,857,617.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	2,180,000.000	2,025,948.120	

ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,860,000.000	3,901,873.280	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,000,000.000	2,072,920.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,800,000.000	1,781,398.800	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	6,440,000.000	6,577,172.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	5,190,000.000	5,440,573.200	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,220,000.000	3,431,876.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,830,000.000	6,066,814.600	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	5,480,000.000	5,965,856.800	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,810,000.000	3,173,529.700	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,620,000.000	1,735,214.400	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	690,000.000	773,697.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,170,000.000	4,762,140.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,950,000.000	3,389,255.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,440,000.000	7,276,556.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,890,000.000	3,404,420.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	5,109,690.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	3,996,360.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	2,860,000.000	2,678,021.060	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	990,000.000	889,322.940	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,660,000.000	1,229,781.120	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	2,240,000.000	1,296,108.800	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	3,640,000.000	3,185,691.600	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	980,000.000	840,514.640	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	3,770,000.000	3,660,496.580	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,110,000.000	1,007,867.790	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,450,000.000	1,138,522.600	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	2,000,000.000	1,931,600.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,330,000.000	2,246,413.580	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	4,460,000.000	4,253,002.480	
NETHERLANDS 01/15/24	4,330,000.000	4,275,303.440	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	680,000.000	688,634.640	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	3,960,000.000	4,041,797.760	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,620,000.000	1,725,363.180	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	3,480,000.000	4,098,222.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,410,000.000	3,117,795.310	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,260,000.000	4,134,006.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	980,000.000	1,205,400.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	3,650,000.000	3,498,342.500	
SPAIN 0.0 01/31/26	3,690,000.000	3,442,419.450	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,000,000.000	1,812,600.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	3,000,000.000	2,671,950.000	
SPAIN 0.0 05/31/24	2,740,000.000	2,671,284.740	

SPAIN 0.0 05/31/25	2,000,000.000	1,898,714.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	2,890,000.000	2,313,445.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	3,060,000.000	2,987,621.820	
SPAIN 0.35 07/30/23	270,000.000	269,112.510	
SPAIN 0.5 04/30/30	4,540,000.000	3,917,141.510	
SPAIN 0.5 10/31/31	3,000,000.000	2,462,451.000	
SPAIN 0.6 10/31/29	2,530,000.000	2,229,380.340	
SPAIN 0.7 04/30/32	5,090,000.000	4,196,705.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	4,500,000.000	4,241,025.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,000,000.000	904,100.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,810,000.000	1,332,485.800	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,180,000.000	815,262.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	3,270,000.000	1,948,808.820	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,580,000.000	1,159,835.340	
SPAIN 1.25 10/31/30	4,770,000.000	4,366,935.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	3,540,000.000	3,440,494.140	
SPAIN 1.4 04/30/28	3,530,000.000	3,370,313.390	
SPAIN 1.4 07/30/28	5,000,000.000	4,802,000.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	3,930,000.000	3,714,541.680	
SPAIN 1.45 10/31/27	5,000,000.000	4,815,465.000	
SPAIN 1.45 10/31/71	1,900,000.000	1,015,151.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	4,340,000.000	4,218,480.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	3,790,000.000	3,785,122.270	
SPAIN 1.85 07/30/35	3,850,000.000	3,397,813.650	
SPAIN 1.9 10/31/52	780,000.000	571,748.580	
SPAIN 1.95 04/30/26	2,770,000.000	2,771,756.180	
SPAIN 1.95 07/30/30	3,660,000.000	3,519,298.620	
SPAIN 2.15 10/31/25	4,460,000.000	4,517,539.790	
SPAIN 2.35 07/30/33	470,000.000	447,675.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,650,000.000	1,519,315.050	
SPAIN 2.75 10/31/24	3,100,000.000	3,196,999.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	3,480,000.000	3,358,474.920	
SPAIN 3.45 07/30/66	2,460,000.000	2,438,137.980	
SPAIN 3.8 04/30/24	4,220,000.000	4,423,487.130	
SPAIN 4.2 01/31/37	3,360,000.000	3,871,603.680	
SPAIN 4.4 10/31/23	6,420,000.000	6,729,514.620	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,250,000.000	1,360,003.750	
SPAIN 4.7 07/30/41	3,490,000.000	4,343,074.660	
SPAIN 4.9 07/30/40	3,210,000.000	4,060,650.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	3,520,000.000	4,151,664.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,220,000.000	1,634,629.200	
SPAIN 5.75 07/30/32	4,810,000.000	6,124,678.820	
SPAIN 5.9 07/30/26	3,100,000.000	3,586,780.600	
SPAIN 6.0 01/31/29	1,140,000.000	1,403,123.400	
ユーロ 小計	1,001,150,000.000 (141,642,702,000)	977,803,396.710 (138,339,624,567)	
国債証券 合計	418,655,444,022.800 (418,655,444,023)	395,394,859,623 (395,394,859,623)	
合計		395,394,859,623	

(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 236銘柄	51.99	50.88
イギリス・ポンド	国債証券 54銘柄	5.20	5.09
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.41	0.40
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	1.57	1.54
オフショア・人民元	国債証券 16銘柄	2.08	2.03
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	2.11	2.07
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.45	0.44
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.28	0.27
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.39	0.38
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.21	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.43	0.42
マレーシア・リングgit	国債証券 27銘柄	0.52	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	0.79	0.77
ユーロ	国債証券 329銘柄	35.75	34.99

(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)

2022年6月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	259,893,023
コール・ローン	154,725,680
投資信託受益証券	7,367,694,216
投資証券	65,024,623,215
派生商品評価勘定	254
未収入金	1,451,580
未収配当金	87,364,729
流動資産合計	72,895,752,697
資産合計	72,895,752,697
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	175,347
未払金	220,663,527
未払解約金	31,945,000
流動負債合計	252,783,874
負債合計	252,783,874
純資産の部	
元本等	
元本	42,385,507,995
剰余金	
剰余金又は欠損金()	30,257,460,828
元本等合計	72,642,968,823
純資産合計	72,642,968,823
負債純資産合計	72,895,752,697

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12月14日 至 2022年6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礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年6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	38,794,144,690円
同期中追加設定元本額	72,449,263,542円
同期中一部解約元本額	68,857,900,237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)	90,236,271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)	51,442,747円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,720,407円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	23,835,555円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	124,969,213円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	32,184,413円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,976,717円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	28,738,279円
たわらノーロード 先進国リート	12,551,040,557円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,108,506,158円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	316,031,030円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,220,561,647円
たわらノーロード バランス(堅実型)	19,984,877円

たわらノーロード バランス(標準型)	374,993,242円
たわらノーロード バランス(積極型)	762,312,114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)	5,559,853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)	91,357,350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)	215,932,169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)	5,325,771円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,138,548円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,922,754円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,175,273,558円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,409,019円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	497,283,471円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	42,883,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	179,983,530円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	232,426,715円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	464,800,445円
投資のソムリエ	11,674,764,886円
投資のソムリエ<DC年金>	731,278,896円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	192,368,902円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	660,517,008円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,373,440,444円
ワールドアセットバランス(基本コース)	355,965,633円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	296,124,910円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	36,458,019円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	18,413,243円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,390,114円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	82,448,556円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	579,216,956円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	147,067,136円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	42,933,275円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	18,398,984円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	12,168,821円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,125,847円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	276,893,448円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	247,939,340円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	983,915円
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)	53,121,417円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	656,048円
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)	22,475,580円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	459,027円
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)	56,379,915円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	583,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	826,526円

インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	692,408円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	302,710,470円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	8,623,168円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,380,735円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	12,564,206円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	58,446,484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)	81,379,635円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	195,060,789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)	1,729,008,684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)	436,434,092円
計	42,385,507,995円
2. 受益権の総数	42,385,507,995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12月14日 至 2022年6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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6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>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6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	669,009,513	
投資証券	6,947,612,299	
合計	7,616,621,812	

(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2022年6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	2022年6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	69,165,212	-	68,990,119	175,093	
イギリス・ポンド	53,997,600	-	53,997,600	-	
オーストラリア・ドル	3,313,574	-	3,313,666	92	
カナダ・ドル	8,690,850	-	8,515,503	175,347	
合計	3,163,188	-	3,163,350	162	
合計	69,165,212	-	68,990,119	175,093	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年6月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7139円 (17,139円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年6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	277,800.000	200,016.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	678,500.000	420,670.000		
		PRIME US REIT	240,200.000	172,944.000		
		アメリカ・ドル	小計	1,269,200.000	793,630.000 (107,140,050)	
	オーストラリア・ドル		ABACUS PROPERTY GROUP	156,865.000	429,810.100	
			ARENA REIT	133,870.000	552,883.100	
			BWP TRUST	184,765.000	716,888.200	
			CENTURIA CAPITAL GROUP	245,796.000	494,049.960	
			CENTURIA INDUSTRIAL REIT	207,140.000	633,848.400	
			CENTURIA OFFICE REIT	155,304.000	288,865.440	
			CHARTER HALL GROUP	187,273.000	2,251,021.460	
			CHARTER HALL LONG WALE REIT	232,224.000	1,038,041.280	
			CHARTER HALL RETAIL REIT	199,122.000	786,531.900	
			CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	135,856.000	460,551.840	
			CROMWELL PROPERTY GROUP	580,575.000	426,722.620	
			DEXUS	424,328.000	4,035,359.280	
			DEXUS INDUSTRIA REIT	89,595.000	249,970.050	
			GDI PROPERTY GROUP	178,986.000	178,091.070	
		GOODMAN GROUP	668,683.000	12,424,130.140		
	GPT GROUP	756,504.000	3,268,097.280			
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	120,295.000	430,656.100			

	HEALTHCO REIT	113,862.000	185,595.060	
	HOME CONSORTIUM LTD	75,401.000	361,170.790	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	557,593.000	699,779.210	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	65,661.000	219,307.740	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	141,361.000	523,035.700	
	IRONGATE GROUP	225,907.000	426,964.230	
	MIRVAC GROUP	1,557,450.000	3,208,347.000	
	NATIONAL STORAGE REIT	412,435.000	936,227.450	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	117,186.400	
	RURAL FUNDS GROUP	156,499.000	438,197.200	
	SCENTRE GROUP	2,045,566.000	5,400,294.240	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	443,045.000	1,209,512.850	
	STOCKLAND	942,611.000	3,412,251.820	
	VICINITY CENTRES	1,530,164.000	2,731,342.740	
	WAYPOINT REIT LTD	277,465.000	652,042.750	
	オーストラリア・ドル 小計	13,342,544.000	49,186,773.400 (4,654,052,499)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	163,795.000	227,675.050	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,325,860.000	3,752,183.800	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	739,216.000	864,882.720	
	CAPITALAND CHINA TRUST	438,180.000	521,434.200	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,007,309.000	4,456,225.980	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	343,800.000	440,064.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	68,564.000	
	ESR LOGOS REIT	1,963,440.000	805,010.400	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	357,300.000	241,177.500	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	544,400.000	157,876.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	408,900.000	936,381.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,159,664.000	1,542,353.120	
	IREIT GLOBAL	222,000.000	137,640.000	
	KEPPEL DC REIT	503,700.000	1,017,474.000	
	KEPPEL REIT	752,200.000	872,552.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	663,300.000	540,589.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	872,100.000	1,587,222.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	770,720.000	1,926,800.000	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,269,120.000	2,119,430.400	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	124,400.000	149,280.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	989,855.000	390,992.720	
		PARKWAY LIFE REIT	148,600.000	731,112.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	194,500.000	158,517.500	
		SPH REIT	394,800.000	373,086.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	585,100.000	345,209.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	867,590.000	1,448,875.300	
	シンガポール・ドル 小計		17,922,249.000	25,812,608.190 (2,505,113,625)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	127,740.000	259,312.200	
	ユーロ 小計		127,740.000	259,312.200 (36,687,490)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	554,000.000	3,761,660.000	
	香港・ドル 小計		554,000.000	3,761,660.000 (64,700,552)	
投資信託受益証券 合計			33,215,733	7,367,694,216 (7,367,694,216)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	33,787.000	604,449.430	
		AGREE REALTY CORP	28,199.000	1,983,799.650	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	27,800.000	534,872.000	
		ALEXANDER'S INC.	903.000	208,475.610	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	57,252.000	8,375,395.080	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,685.000	48,571.650	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	20,107.000	620,703.090	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	54,873.000	3,554,124.210	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	116,354.000	4,181,762.760	
		AMERICOLD REALTY TRUST	105,266.000	3,179,033.200	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	61,985.000	2,565,559.150	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	62,076.000	384,871.200	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	84,233.000	1,335,935.380	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	27,465.000	371,326.800	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,107.000	108,166.120	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	54,961.000	10,686,616.840	

BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	11,577.000	307,948.200	
BOSTON PROPERTIES INC	55,964.000	5,424,030.880	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,173.000	120,231.080	
BRANDYWINE REALTY TRUST	65,259.000	675,430.650	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	117,575.000	2,561,959.250	
BROADSTONE NET LEASE INC	64,001.000	1,317,780.590	
BRT APARTMENTS CORP	4,220.000	92,164.800	
CAMDEN PROPERTY TRUST	40,239.000	5,359,432.410	
CARETRUST REIT INC	37,042.000	686,758.680	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10,574.000	290,679.260	
CEDAR REALTY TRUST INC	5,369.000	136,963.190	
CENTERSPACE	6,062.000	494,356.100	
CHATHAM LODGING TRUST	17,214.000	211,043.640	
CITY OFFICE REIT INC	15,394.000	191,347.420	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	41,298.320	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9,614.000	348,795.920	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	44,645.000	1,206,307.900	
COUSINS PROPERTIES INC	58,820.000	1,894,592.200	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	4,068.000	30,306.600	
CTO REALTY GROWTH INC	2,558.000	158,902.960	
CUBESMART	86,266.000	3,571,412.400	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	84,259.000	812,256.760	
DIGITAL REALTY TRUST INC	111,563.000	14,654,915.680	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80,900.000	165,845.000	
DOUGLAS EMMETT INC	69,443.000	1,749,963.600	
DUKE REALTY TRUST	149,847.000	7,459,383.660	
EAST GROUP	16,065.000	2,517,546.150	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	32,929.000	634,541.830	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	57,368.000	422,802.160	
EPR PROPERTIES	29,662.000	1,426,148.960	
EQUINIX INC	35,479.000	23,031,902.430	
EQUITY COMMONWEALTH	44,939.000	1,233,575.550	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	68,003.000	4,788,771.260	
EQUITY RESIDENTIAL	134,407.000	9,710,905.750	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	48,424.000	1,053,706.240	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,678.000	6,956,426.980	

EXTRA SPACE STORAGE INC	52,667.000	8,791,175.640	
FARMLAND PARTNERS INC	9,907.000	140,481.260	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	27,918.000	2,846,240.100	
FIRST INDUSTRIAL RT	51,444.000	2,551,107.960	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	29,428.000	784,550.480	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,176.000	139,007.440	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	92,531.000	4,258,276.620	
GETTY REALTY CORP	16,010.000	433,390.700	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,370.000	296,179.900	
GLADSTONE LAND CORP	12,783.000	310,371.240	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	24,812.000	297,744.000	
GLOBAL NET LEASE INC	39,687.000	559,189.830	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	58,463.000	1,536,992.270	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	87,212.000	2,529,148.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	212,310.000	5,441,505.300	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,196.000	166,093.200	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	41,567.000	1,521,352.200	
HOST HOTELS & RESORTS INC	281,108.000	5,239,853.120	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	60,688.000	1,097,845.920	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	87,293.000	1,941,396.320	
INDUS REALTY TRUST INC	2,312.000	139,575.440	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,637.000	384,638.280	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,790.000	1,394,391.700	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	25,576.000	706,153.360	
INVITATION HOMES INC	234,759.000	8,472,452.310	
IRON MOUNTAIN INC	113,988.000	5,817,947.520	
JBG SMITH PROPERTIES	45,433.000	1,129,010.050	
KILROY REALTY CORP	41,496.000	2,256,552.480	
KIMCO REALTY	242,820.000	5,014,233.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	86,711.000	1,634,502.350	
LIFE STORAGE INC	32,337.000	3,494,336.220	
LTC PROPERTIES INC	15,083.000	581,902.140	
LXP INDUSTRIAL TRUST	112,327.000	1,217,624.680	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	235,234.000	3,761,391.660	
MID AMERICA	45,380.000	7,631,100.800	

NATIONAL HEALTH INVS INC	18,268.000	1,115,444.080	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	69,308.000	2,933,114.560	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	32,463.000	1,580,948.100	
NETSTREIT CORP	16,235.000	328,921.100	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,684.000	571,233.520	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	19,699.000	407,375.320	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	94,351.000	2,833,360.530	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,609.000	147,572.790	
ORION OFFICE REIT INC	23,386.000	282,269.020	
PARAMOUNT GROUP INC	66,138.000	528,442.620	
PARK HOTELS & RESORTS INC	93,625.000	1,576,645.000	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	52,203.000	1,106,181.570	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,075.000	8,955.100	
PHILLIPS EDISON & CO INC	44,989.000	1,488,686.010	
PHYSICIANS REALTY TRUST	87,308.000	1,566,305.520	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,385.000	657,229.950	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,541.000	254,570.800	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,420.000	82,275.600	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	17,277.000	430,542.840	
PROLOGIS INC	291,521.000	34,177,922.040	
PS BUSINESS PARKS	7,975.000	1,493,637.750	
PUBLIC STORAGE	60,121.000	18,482,999.030	
REALTY INCOME CORP	222,414.000	14,670,427.440	
REGENCY CENTERS CORP	60,738.000	3,703,803.240	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	46,181.000	764,757.360	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	63,162.000	3,860,461.440	
RLJ LODGING TRUST	66,602.000	843,847.340	
RPT REALTY	34,311.000	368,843.250	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,777.000	1,870,426.530	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	90,864.000	1,295,720.640	
SAFEHOLD INC	4,985.000	191,224.600	
SAUL CENTERS INC	4,594.000	206,913.760	
SERVICE PROPERTIES TRUST	66,926.000	425,649.360	
SIMON PROPERTY GROUP INC	129,192.000	13,081,981.920	

	SITE CENTERS CORP	70,086.000	958,776.480	
	SL GREEN	25,421.000	1,345,787.740	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	50,495.000	1,997,077.250	
	STAG INDUSTRIAL INC	69,631.000	2,234,458.790	
	STORE CAPITAL CORP	96,900.000	2,557,191.000	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	43,350.000	369,775.500	
	SUN COMMUNITIES INC	45,634.000	7,119,360.340	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	87,396.000	963,103.920	
	TANGER FACTORY OUTLET	39,698.000	629,213.300	
	TERRENO REALTY CORP	29,883.000	1,724,249.100	
	THE MACERICH COMPANY	85,174.000	851,740.000	
	THE NECESSITY RETAIL REIT INC	50,393.000	371,396.410	
	UDR INC	117,762.000	5,271,027.120	
	UMH PROPERTIES INC	18,628.000	342,755.200	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,306.000	282,120.020	
	URBAN EDGE PROPERTIES	41,929.000	698,537.140	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12,666.000	208,102.380	
	VENTAS INC	157,033.000	8,264,646.790	
	VERIS RESIDENTIAL INC	32,305.000	496,204.800	
	VICI PROPERTIES INC	331,553.000	9,926,696.820	
	VORNADO REALTY TRUST	62,874.000	1,966,698.720	
	WASHINGTON REIT	32,218.000	774,198.540	
	WELLTOWER INC	171,118.000	14,043,654.260	
	WHITESTONE REIT	16,382.000	184,461.320	
	WP CAREY INC	75,034.000	6,212,815.200	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,441.000	742,406.690	
アメリカ・ドル	小計	8,671,829.000	408,876,954.680 (55,198,388,885)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	58,660.000	71,799.840	
	ASSURA PLC	1,173,818.000	814,629.690	
	BIG YELLOW GROUP PLC	68,770.000	880,256.000	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	308,174.000	368,576.100	
	BRITISH LAND CO PLC	370,518.000	1,902,980.440	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	325,130.000	507,853.060	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	258,047.000	213,146.820	
	CUSTODIAN REIT PLC	179,251.000	186,062.530	
	DERWENT LONDON PLC	44,451.000	1,266,853.500	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	248,948.000	223,804.250	

	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	96,625.000	621,298.750	
	HAMMERSON PLC	1,346,495.000	336,623.750	
	HOME REIT PLC	230,322.000	266,252.230	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	136,070.000	167,093.960	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	296,548.000	2,207,503.310	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	388,785.000	940,859.700	
	LXI REIT PLC	348,501.000	498,356.430	
	NEWRIVER REIT PLC	113,346.000	100,311.210	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	226,467.000	224,655.260	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	532,012.000	759,181.120	
	PRS REIT PLC/THE	225,937.000	244,915.700	
	REGIONAL REIT LTD	150,233.000	123,191.060	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	83,810.000	873,300.200	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	242,863.000	136,731.860	
	SEGRO PLC	473,284.000	4,796,733.340	
	SHAFTESBURY PLC	109,619.000	644,559.720	
	STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	173,757.000	139,005.600	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	377,025.000	490,132.500	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	158,195.000	137,629.650	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	739,160.000	1,441,362.000	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	333,520.000	275,821.040	
	UNITE GROUP PLC	157,747.000	1,708,400.010	
	WORKSPACE GROUP PLC	53,862.000	356,297.130	
	イギリス・ボンド 小計	10,260,990.000	23,926,177.760 (3,964,328,393)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	71,574.000	1,268,291.280	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	87,076.000	805,453.000	
	イスラエル・シュケル 小計	158,650.000	2,073,744.280 (82,536,267)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	24,986.000	909,990.120	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,665.000	298,179.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,481.000	99,871.350	

	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,850.000	413,472.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	59,378.550	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	33,739.000	1,572,237.400	
	CHOICE PROPERTIES REIT	64,243.000	923,814.340	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	21,079.000	347,803.500	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,502.000	359,728.460	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	46,340.000	603,810.200	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	8,213.000	171,405.310	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,151.000	91,160.810	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,323.000	620,258.230	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,842.000	1,080,782.720	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	54,059.000	732,499.450	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	34,868.930	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	28,340.000	359,634.600	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,004.000	381,549.360	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,724.000	143,248.080	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,458.000	114,564.920	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,602.000	138,369.960	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	42,403.000	537,670.040	
	PLAZA RETAIL REIT	16,376.000	75,002.080	
	PRIMARIS REIT	19,470.000	257,393.400	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	60,325.000	1,291,558.250	
	SLATE GROCERY REIT	12,407.000	184,864.300	
	SLATE OFFICE REIT	15,735.000	76,000.050	
	SMARTCENTRES REIT	27,087.000	772,250.370	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	34,966.000	617,499.560	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	16,803.000	107,035.110	
カナダ・ドル	小計	733,239.000	13,375,900.450 (1,410,488,702)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	344,515.000	422,030.870	

	GOODMAN PROPERTY TRUST	401,969.000	828,056.140	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	637,666.000	644,042.660	
	PRECINCT PROPERTIES	501,670.000	692,304.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	185,710.000	522,773.650	
ニュージーランド・ドル 小計		2,071,530.000	3,109,207.920 (265,868,369)	
ユーロ	AEDIFICA	14,386.000	1,405,512.200	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	5,513.000	73,874.200	
	ALTAREA	1,766.000	235,231.200	
	BEFIMMO	9,418.000	444,529.600	
	CARE PROPERTY INVEST NV	11,125.000	264,775.000	
	CARMILA SA	16,531.000	231,434.000	
	COFINIMMO SA	11,688.000	1,334,769.600	
	COIMA RES SPA	7,596.000	74,972.520	
	COVIVIO	18,770.000	1,147,785.500	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,280.000	354,496.000	
	GECINA SA	21,475.000	2,237,695.000	
	HAMBORNER REIT AG	27,918.000	242,049.060	
	HIBERNIA REIT PLC	255,459.000	408,223.480	
	ICADE	12,211.000	610,550.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	21,491.000	79,086.880	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	106,885.000	747,126.150	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,632.000	227,021.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	173,656.000	229,573.230	
	KLEPIERRE	77,232.000	1,570,126.560	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	18,955.000	92,879.500	
	MERCIALYS	17,947.000	157,395.190	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	132,251.000	1,322,510.000	
	MONTEA SCA	3,948.000	356,504.400	
	NSI NV	6,981.000	247,825.500	
	RETAIL ESTATES	4,426.000	287,247.400	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	45,927.000	2,751,486.570	
VASTNED RETAIL	7,293.000	171,385.500		
WAREHOUSES DE PAUW	55,537.000	1,781,626.960		
WERELDHAVE NV	16,663.000	242,779.910		
XIOR STUDENT HOUSING NV	8,225.000	362,722.500		
ユーロ 小計		1,135,185.000	19,693,195.210 (2,786,193,258)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	19,893.000	104,836,110.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	57,473.000	375,298,690.000	

	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,032.000	65,861,040.000	
	JR REIT XXVII	54,634.000	313,052,820.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	16,453.000	106,450,910.000	
	LOTTE REIT CO LTD	50,604.000	306,660,240.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	38,228.000	183,494,400.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	24,013.000	192,344,130.000	
	SK REITS CO LTD	20,394.000	140,922,540.000	
	韓国・ウォン 小計	292,724.000	1,788,920,880.000 (188,015,584)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	776,070.000	2,809,373.400	
	LINK REIT	830,320.000	57,375,112.000	
	PROSPERITY REIT	473,000.000	1,262,910.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	374,000.000	1,439,900.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	887,000.000	2,740,830.000	
	香港・ドル 小計	3,340,390.000	65,628,125.400 (1,128,803,757)	
投資証券 合計		26,664,537	65,024,623,215 (65,024,623,215)	
合計			72,392,317,431 (72,392,317,431)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 4銘柄 投資証券 147銘柄	0.15 -	- 75.99	76.40
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-	5.46	5.48
イスラエル・シケル	投資証券 2銘柄	-	0.11	0.11
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 32銘柄	6.41	-	6.43
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	-	1.94	1.95
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 26銘柄	3.45	-	3.46
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-	0.37	0.37
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 30銘柄	0.05 -	- 3.84	3.90
韓国・ウォン	投資証券 9銘柄	-	0.26	0.26
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 5銘柄	0.09 -	- 1.55	1.65

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年6月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,951,149,414
コール・ローン	184,382,612
株式	61,191,062,917
投資信託受益証券	355,675,058
投資証券	59,338,353
派生商品評価勘定	972
未収入金	24,079,301
未収配当金	146,794,274
差入委託証拠金	2,063,160,843
流動資産合計	67,975,643,744
資産合計	
67,975,643,744	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	103,758,300
未払金	764,957,058
未払解約金	78,025,000
流動負債合計	946,740,358
負債合計	
946,740,358	
純資産の部	
元本等	
元本	45,900,304,902
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,128,598,484
元本等合計	67,028,903,386
純資産合計	
67,028,903,386	
負債純資産合計	
67,975,643,744	

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12月14日 至 2022年6月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年6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	47,607,871,422円
同期中追加設定元本額	33,499,272,949円
同期中一部解約元本額	35,206,839,469円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	8,319,425,161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)	295,053,198円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	5,065,871円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	18,688,546円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	100,730,476円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,388,735円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,458,633円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,260,612円
たわらノーロード 新興国株式	9,578,586,845円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	3,101,372,159円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,818,423,463円
たわらノーロード バランス(堅実型)	23,889,737円
たわらノーロード バランス(標準型)	89,657,934円
たわらノーロード バランス(積極型)	151,887,644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)	136,159,873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)	219,718,416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)	191,773,259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)	274,556,083円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	602,329円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	20,004,270円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,038,659円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,633,216円
たわらノーロード 全世界株式	174,194,833円
One DC 新興国株式インデックスファンド	417,217,521円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	393,551,403円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	357,147,590円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	491,188,170円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	967,495,787円
投資のソムリエ	10,185,800,391円
クルーズコントロール	335,219,299円
投資のソムリエ<DC年金>	637,923,633円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	377,344,929円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	538,253,057円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,743,206,892円
ワールドアセットバランス(基本コース)	699,724,095円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	571,570,865円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	22,769,965円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,495,325円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,576,805円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	73,584,058円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	425,959,729円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	307,150,832円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	26,810,101円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,490,659円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,598,991円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,328,316円
エマージング株式パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	13,693,010円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	264,421,242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)	10,718,590円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	47,281,694円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	244,145,106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)	120,973,804円
計	45,900,304,902円

2. 受益権の総数

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月14日 至 2022年6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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	2,083,043,325	
投資信託受益証券	44,047,997	
投資証券	4,906,314	
合計	2,131,997,636	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年4月19日から2022年6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	2022年6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	65,605,140	-	65,604,168		972
アメリカ・ドル	65,605,140	-	65,604,168		972
合計	65,605,140	-	65,604,168		972

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年6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 先物取引					
買建	5,500,565,550	-	5,396,807,250		103,758,300
合計	5,500,565,550	-	5,396,807,250		103,758,300

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年6月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4603円 (14,603円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年6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	36,666	22.430	822,418.380	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	12,755	8.190	104,463.450	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	4,944	125.780	621,856.320	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,892	60.110	354,168.120	
	LUKOIL SPON ADR	33,845	0.000	0.000	
	GAZPROM PAO ADR	483,471	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	128,421	1.930	247,852.530	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	67,100	1.693	113,600.300	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,488	0.933	80,693.300	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	23,800	3.986	94,866.800	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	10,735	1.500	16,102.500	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	107,951	0.000	0.000	
	SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000	
TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000		
VTB BANK OJSC GDR	152,000	0.000	0.000		
MAGNIT PJSC GDR	37,870	0.000	0.000		
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,924	10.560	326,557.440		

TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	4.700	115,751.600	
VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000	
YANDEX NV	25,601	0.000	0.000	
SBERBANK ADR	224,278	0.000	0.000	
PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000	
HUAZHU GROUP LTD ADR	13,179	31.320	412,766.280	
JOYY INC-ADR	4,368	32.670	142,702.560	
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	4,112	62.220	255,848.640	
ZAI LAB LTD ADR	6,331	26.610	168,467.910	
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
360 DIGITECH INC ADR	5,813	16.310	94,810.030	
NIO INC ADR	87,940	18.140	1,595,231.600	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	50,131	4.390	220,075.090	
AUTOHOME INC ADR	5,337	34.800	185,727.600	
WEIBO CORP ADR	4,386	22.310	97,851.660	
KANZHUN LTD ADR	5,650	23.490	132,718.500	
RLX TECHNOLOGY INC ADR	30,011	2.300	69,025.300	
KE HOLDINGS INC ADR	20,023	14.500	290,333.500	
LEGEND BIOTECH CORP ADR	2,864	44.510	127,476.640	
LI AUTO INC ADR	36,778	29.930	1,100,765.540	
XPENG INC ADR	28,404	25.810	733,107.240	
OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
LUFAX HOLDING LTD ADR	58,560	6.000	351,360.000	
PINDUODUO INC ADR	29,368	59.950	1,760,611.600	
YUM CHINA HOLDINGS INC	28,036	42.860	1,201,622.960	
IQIYI INC ADR	27,254	4.250	115,829.500	
POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
HUTCHMED CHINA LTD ADR	6,136	9.900	60,746.400	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	28,295	25.650	725,766.750	
BEIGENE LTD ADR	3,171	147.470	467,627.370	
アメリカ・ドル 小計	2,299,173		13,208,803.410 (1,783,188,460)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム				
ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	88,305	8.240	727,633.200	
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	197,234	5.890	1,161,708.260	
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	231,448	27.500	6,364,820.000	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	191,403	9.730	1,862,351.190	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	294,659	19.680	5,798,889.120	
EMAAR PROPERTIES PJSC	268,691	5.750	1,544,973.250	
ALDAR PROPERTIES PJSC	273,432	5.040	1,378,097.280	
EMIRATES NBD BANK PJSC	144,803	13.550	1,962,080.650	

	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	188,136	4.180	786,408.480	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,878,111		21,586,961.430 (794,616,050)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	202,640	2,714.250	550,015,620.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	61,205	331.000	20,258,855.000	
	ASIAN PAINTS LTD	25,667	2,708.750	69,525,486.250	
	EICHER MOTORS LTD	9,376	2,712.850	25,435,681.600	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	17,291	1,326.500	22,936,511.500	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	58,364	1,036.500	60,494,286.000	
	SHREE CEMENT LTD	709	19,178.850	13,597,804.650	
	ICICI BANK LTD	340,870	720.000	245,426,400.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	50,310	237.600	11,953,656.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	117,731	461.850	54,374,062.350	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	18,416	650.050	11,971,320.800	
	TATA STEEL LTD	49,675	1,023.700	50,852,297.500	
	TATA MOTORS LTD	110,235	428.050	47,186,091.750	
	JSW STEEL LTD	45,446	572.500	26,017,835.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	34,551	756.600	26,141,286.600	
	TATA POWER CO LTD	98,347	230.250	22,644,396.750	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	7,269	3,360.850	24,430,018.650	
	NESTLE INDIA LTD	2,172	16,774.900	36,435,082.800	
	GAIL INDIA LTD	113,561	149.100	16,931,945.100	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	37,549	1,791.800	67,280,298.200	
	VEDANTA LTD	48,784	301.200	14,693,740.800	
	AXIS BANK LTD	151,951	660.700	100,394,025.700	
	TITAN COMPANY LTD	23,196	2,142.250	49,691,631.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	179,820	164.650	29,607,363.000	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	8,871	1,517.100	13,458,194.100	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	87,255	246.700	21,525,808.500	
	LUPIN LTD	14,624	618.650	9,047,137.600	
	MPHASIS LTD	5,719	2,507.850	14,342,394.150	
	ACC LTD	5,137	2,135.400	10,969,549.800	
	BAJAJ FINANCE LTD	17,871	5,667.500	101,283,892.500	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	115,081	2,179.800	250,853,563.800	
	INFOSYS LTD	223,517	1,476.800	330,089,905.600	
WIPRO LTD	88,836	460.950	40,948,954.200		
TATA ELXSI LTD	2,267	8,602.900	19,502,774.300		
MRF LTD	115	69,952.250	8,044,508.750		
INDIAN OIL CORP LTD	140,856	117.250	16,515,366.000		
HINDUSTAN UNILEVER LTD	54,568	2,199.900	120,044,143.200		
TRENT LTD	12,243	1,113.300	13,630,131.900		

APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,771	3,700.500	25,056,085.500	
HCL TECHNOLOGIES LTD	72,090	1,015.350	73,196,581.500	
DABUR INDIA LTD	40,095	502.250	20,137,713.750	
HERO MOTOCORP LTD	8,031	2,601.950	20,896,260.450	
SRF LTD	9,583	2,304.550	22,084,502.650	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	5,256	2,197.700	11,551,111.200	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,895	4,351.550	34,355,487.250	
BHARTI AIRTEL LTD	146,609	673.350	98,719,170.150	
UNITED SPIRITS LTD	21,413	786.350	16,838,112.550	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	63,967	845.700	54,096,891.900	
DIVI'S LABORATORIES LTD	8,733	3,528.050	30,810,460.650	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,232	7,935.100	65,321,743.200	
AUROBINDO PHARMA LTD	14,788	533.600	7,890,876.800	
HAVELLS INDIA LTD	16,463	1,123.450	18,495,357.350	
INDRAPRASTHA GAS LTD	22,037	360.650	7,947,644.050	
JINDAL STEEL & POWER LTD	24,858	367.550	9,136,557.900	
BIOCON LTD	25,792	339.000	8,743,488.000	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	85,979	122.700	10,549,623.300	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	12,529	1,165.300	14,600,043.700	
PETRONET LNG LTD	51,266	221.200	11,340,039.200	
CIPLA LTD/INDIA	32,755	966.800	31,667,534.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	45,966	1,585.100	72,860,706.600	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,679	5,511.050	36,808,302.950	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	61,234	3,359.900	205,740,116.600	
ADANI ENTERPRISES LTD	17,751	2,203.100	39,107,228.100	
NTPC LTD	270,554	155.250	42,003,508.500	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,899	1,701.650	13,441,333.350	
YES BANK LTD	714,850	12.950	9,257,307.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	39,375	365.150	14,377,781.250	
BHARAT FORGE LTD	17,411	676.600	11,780,282.600	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	94,436	385.750	36,428,687.000	
ITC LTD	200,535	270.150	54,174,530.250	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,845	2,108.800	20,761,136.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	34,882	734.400	25,617,340.800	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,523	2,864.250	10,090,752.750	
SIEMENS INDIA LTD	4,533	2,371.600	10,750,462.800	
INFO EDGE INDIA LTD	4,591	3,680.900	16,899,011.900	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	29,658	749.950	22,242,017.100	
TECH MAHINDRA LTD	38,994	1,109.850	43,277,490.900	
MINDTREE LTD	4,147	3,062.250	12,699,150.750	

MARICO LTD	33,449	492.550	16,475,304.950	
PAGE INDUSTRIES LTD	406	41,346.650	16,786,739.900	
DLF LTD	46,735	322.100	15,053,343.500	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	217,531	224.450	48,824,832.950	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	32,222	726.400	23,406,060.800	
BAJAJ FINSERV LTD	2,483	12,253.500	30,425,440.500	
BAJAJ AUTO LTD	4,501	3,881.000	17,468,381.000	
JUBILANT FOODWORKS LTD	27,088	524.700	14,213,073.600	
ADANI POWER LTD	47,501	280.100	13,305,030.100	
MUTHOOT FINANCE LTD	8,518	1,062.350	9,049,097.300	
COAL INDIA LTD	99,415	198.500	19,733,877.500	
INDUS TOWERS LTD	47,485	206.800	9,819,898.000	
PI INDUSTRIES LTD	4,860	2,578.150	12,529,809.000	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	3,401	4,331.450	14,731,261.450	
ADANI GREEN ENERGY LTD	21,144	1,757.600	37,162,694.400	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	64,690	593.100	38,367,639.000	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	10,214	603.050	6,159,552.700	
BANDHAN BANK LTD	37,750	323.600	12,215,900.000	
ADANI TOTAL GAS LTD	18,226	2,398.300	43,711,415.800	
GODREJ PROPERTIES LTD	9,674	1,313.400	12,705,831.600	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	27,892	650.350	18,139,562.200	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	15,935	770.000	12,269,950.000	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	16,598	644.650	10,699,900.700	
ZOMATO LTD	113,629	69.000	7,840,401.000	
BERGER PAINTS INDIA LTD	16,178	580.750	9,395,373.500	
ADANI TRANSMISSIONS LTD	18,255	2,051.900	37,457,434.500	
AVENUE SUPERMARTS LTD	10,877	3,755.650	40,850,205.050	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	16,327	1,121.050	18,303,383.350	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	24,128	559.050	13,488,758.400	
INTERGLOBE AVIATION LTD	6,469	1,808.900	11,701,774.100	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	30,238	1,154.900	34,921,866.200	
インド・ルピー 小計	5,907,919		4,487,518,247.200 (7,808,281,750)	
インドネシア・ルピア				
ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,290.000	1,309,193,000.000	
BARITO PACIFIC TBK PT	1,989,200	775.000	1,541,630,000.000	
UNITED TRACTORS TBK PT	122,201	32,200.000	3,934,872,200.000	

INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	304,400	6,875.000	2,092,750,000.000	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	485,400	4,750.000	2,305,650,000.000	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,375,400	6,925.000	9,524,645,000.000	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,384,800	4,020.000	13,606,896,000.000	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	473,200	5,025.000	2,377,830,000.000	
GUDANG GARAM TBK PT	32,400	30,850.000	999,540,000.000	
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	8,375.000	1,597,950,000.000	
BANK MANDIRI	1,238,400	8,175.000	10,123,920,000.000	
BANK RAKYAT INDONESIA	4,480,700	4,400.000	19,715,080,000.000	
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	535,300	8,300.000	4,442,990,000.000	
KALBE FARMA TBK PT	1,478,000	1,625.000	2,401,750,000.000	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	164,300	6,900.000	1,133,670,000.000	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	3,660,600	7,350.000	26,905,410,000.000	
VALE INDONESIA TBK PT	168,900	7,400.000	1,249,860,000.000	
ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	934,100	3,430.000	3,203,963,000.000	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,500.000	1,402,500,000.000	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	2,810.000	1,498,573,000.000	
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	991,300	1,795.000	1,779,383,500.000	
SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,656,400	920.000	1,523,888,000.000	
ADARO MINERALS INDONESIA TBK PT	490,100	2,280.000	1,117,428,000.000	
BANK JAGO TBK PT	270,200	8,700.000	2,350,740,000.000	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	868,982	4,970.000	4,318,840,540.000	
インドネシア・ルピア 小計	26,565,083		122,458,952,240.000 (1,138,868,256)	
オフショア・人 民元				
EVE ENERGY CO LTD	8,232	96.450	793,976.400	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	16.910	100,445.400	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	127.000	381,000.000	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	23.200	69,600.000	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	8.860	106,320.000	

JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	5,200	131.480	683,696.000	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	5,200	11.660	60,632.000	
UNISPLENDOUR CORP LTD	7,540	17.930	135,192.200	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	12.120	231,492.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	95.650	114,780.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	3,900	30.390	118,521.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	20.520	153,900.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	175.500	368,550.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	36.260	192,178.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	18.740	260,486.000	
GEM CO LTD	29,100	8.130	236,583.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	119.120	309,712.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	45.140	311,466.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	4.790	89,094.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	6,500	93.050	604,825.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	11,995	11.980	143,700.100	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	28.910	170,684.640	
ZHEJIANG NHU CO LTD	10,612	22.450	238,239.400	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	22.570	60,036.200	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	18.050	119,130.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	29.800	151,980.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	9.990	25,974.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	60.050	276,230.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	44.590	463,736.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	11.320	124,520.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	19,600	51.580	1,010,968.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	7,200	90.660	652,752.000	

SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	16.290	293,220.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	13.700	246,600.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	10.710	119,952.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.330	94,233.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	6.310	198,134.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	14.300	80,080.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	2.720	38,896.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	8.580	23,423.400	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	18.620	48,412.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	19.270	150,306.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	40,650	16.310	663,001.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	41.650	249,900.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,600	202.400	526,240.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	25.360	90,535.200	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	9.260	117,602.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	5.640	48,504.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	5.900	216,530.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	21,681	37.100	804,365.100	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	28.870	311,796.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	560	37.230	20,848.800	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	17.340	119,646.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	5.270	201,314.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	31.970	156,653.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	9.460	144,738.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	5.780	121,380.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	41.120	308,400.000	

YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	45.840	229,200.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	6,200	3.700	22,940.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	6,600	22.630	149,358.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	27.320	267,736.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	6,600	219.100	1,446,060.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	65.010	721,611.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	8.050	120,347.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	6.860	121,422.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	14,200	45.730	649,366.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	12.740	75,675.600	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,448	15.050	112,092.400	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	92.010	193,221.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.590	240,403.200	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	8.900	127,270.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	27,154	34.180	928,123.720	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.670	155,925.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.400	456,320.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	14.350	285,565.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	15.790	301,589.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	6.110	23,218.000	
IFLYTEK CO LTD	11,800	37.890	447,102.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.380	222,292.000	
GOERTEK INC	13,300	39.150	520,695.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.110	130,143.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	31,200	34.470	1,075,464.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	12,400	10.160	125,984.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	4.290	203,346.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	6.040	170,932.000	

SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	5.570	209,432.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	29,760	15.600	464,256.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.530	148,231.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,100	27.800	336,380.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	5,320	56.600	301,112.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	59,649	24.240	1,445,891.760	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	5,400	169.390	914,706.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	16,400	177.420	2,909,688.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	5.620	116,896.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	125,800	3.710	466,718.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	25,300	12.360	312,708.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	10,100	31.550	318,655.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.590	405,657.000	
PING AN BANK CO LTD	88,700	14.320	1,270,184.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	34,080	18.450	628,776.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	71,200	4.180	297,616.000	
CHINA VANKE CO LTD	31,900	17.860	569,734.000	
ZTE CORP	19,700	24.470	482,059.000	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	5.980	170,430.000	
WEICHAI POWER CO LTD	16,000	12.150	194,400.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	34.300	144,060.000	
GF SECURITIES CO LTD	21,900	18.670	408,873.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	12.660	267,126.000	
BYD CO LTD	7,700	348.800	2,685,760.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	4.620	157,542.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	46.600	450,156.000	

SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	44.600	232,812.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	20.390	224,290.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	17.420	311,818.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	69.350	145,635.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	23.680	277,056.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	54.790	158,891.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	21.300	170,400.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,300	272.010	625,623.000	
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	5.480	19,728.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	10.440	314,244.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	8.130	278,046.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	5.190	297,387.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	14.200	78,810.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	2,000	223.270	446,540.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	11.380	177,528.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	59.300	391,380.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	53.760	32,256.000	
NINESTAR CORP	5,700	47.730	272,061.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	17.500	122,850.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.330	112,554.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	8.680	104,160.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	4,520	57.930	261,843.600	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	50.680	81,088.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,300	271.600	353,080.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	168.090	302,562.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	4.960	74,896.000	
SF HOLDING CO LTD	17,200	52.600	904,720.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	89.980	161,964.000	

FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	6.030	142,308.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	79.610	318,440.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	91.290	228,225.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	6.520	415,910.800	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	8.400	326,760.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	110.720	254,656.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	23.770	323,272.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	5,880	70.770	416,127.600	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	7,000	28.200	197,400.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	20,200	23.160	467,832.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	82.240	254,944.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.710	240,975.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,560	33.590	52,400.400	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	11,500	12.030	138,345.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	59.310	219,447.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	31.700	164,840.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	10,913	27.320	298,143.160	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	78.000	245,700.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,200	231.100	739,520.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	75.390	203,553.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	47.860	148,366.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	120.000	252,000.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	81.700	744,777.200	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	15.560	147,820.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	33.480	100,440.000	
SHENAN CIRCUITS CO LTD	840	93.430	78,481.200	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	1,800	144.620	260,316.000	

ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	45.700	123,390.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	46.350	61,645.500	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	67.550	87,815.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	55.660	166,980.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	38.960	124,672.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.750	98,425.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	111.170	266,808.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	17.270	367,851.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	75.100	142,690.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	8.340	81,732.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	9.600	538,560.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,300	306.550	1,624,715.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.580	117,490.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	102.000	122,400.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	44.610	181,116.600	
SG MICRO CORP	900	266.800	240,120.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	9,600	454.000	4,358,400.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,016	136.710	412,317.360	
WUXI APPTTEC CO LTD	11,872	102.830	1,220,797.760	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	44.300	456,290.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	67.730	494,429.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	1,600	195.000	312,000.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	29,700	16.610	493,317.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	3,300	130.310	430,023.000	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	600	355.060	213,036.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	106.880	117,568.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,900	87.140	339,846.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	1,800	91.420	164,556.000	

ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	126.670	380,010.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	68.910	372,114.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	700	104.830	73,381.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	165.400	628,520.000	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	2,380	132.600	315,588.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	26.060	333,568.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	3.330	380,619.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	3.520	248,864.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	29.390	314,473.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.940	221,712.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	1,260	159.840	201,398.400	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	58.000	168,200.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	168,100	4.710	791,751.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	345.200	276,160.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	960	387.200	371,712.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	5.260	566,502.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	87.230	200,629.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	164.380	230,132.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	46.720	284,992.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	47.160	75,456.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	1,200	30.400	36,480.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,200	135.170	297,374.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	6,200	100.440	622,728.000	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	7.680	273,408.000	

BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	2,755	129.980	358,094.900	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	140.000	84,000.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,500	42.320	317,400.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	800	528.500	422,800.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	101.000	323,200.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,047	212.860	435,724.420	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	11,000	24.500	269,500.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	455	689.340	313,649.700	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	66,000	2.430	160,380.000	
PETROCHINA CO LTD	100,600	5.890	592,534.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	218,800	4.690	1,026,172.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	289,900	3.020	875,498.000	
BANK OF CHINA LTD	114,800	3.230	370,804.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	143,200	4.230	605,736.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	25.660	256,600.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	25,400	34.810	884,174.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	86,600	40.120	3,474,392.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	46,900	44.940	2,107,686.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	91,100	20.330	1,852,063.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	102,000	7.930	808,860.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	3.850	532,070.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	25,700	17.550	451,035.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	5,100	1,900.600	9,693,060.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	5.010	633,765.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	50,100	20.790	1,041,579.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	22,300	21.840	487,032.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	6.150	235,545.000	

CHINA YANGTZE POWER CO LTD	97,500	24.020	2,341,950.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.710	554,246.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	215,100	3.150	677,565.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	159,200	5.480	872,416.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	9.630	534,465.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.080	359,156.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	21,800	37.330	813,794.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.500	395,550.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	87,800	3.500	307,300.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	83,000	6.680	554,440.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	12,500	35.600	445,000.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	14.230	476,705.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	22,500	6.490	146,025.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	36.520	427,284.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	15.530	700,403.000	
CRRC CORP LTD	77,000	5.100	392,700.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	30,652	31.560	967,377.120	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	16,800	39.590	665,112.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	22,600	14.110	318,886.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	92,100	6.320	582,072.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	4,600	29.300	134,780.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,700	24.020	665,354.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	28,700	16.810	482,447.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	3.800	384,940.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	6.000	337,200.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	42.750	337,725.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	12.000	316,800.000	
GEMDALE CORP	10,600	11.750	124,550.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	12,400	87.420	1,084,008.000	

SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.130	325,031.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	86,400	10.190	880,416.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	18,300	6.570	120,231.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	10.480	331,168.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	20,120	33.700	678,044.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.510	134,398.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	8,700	187.750	1,633,425.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	13,800	16.080	221,904.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	2.140	476,150.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	1,600	92.100	147,360.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.520	88,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	26,100	5.150	134,415.000	
AIR CHINA LTD	28,400	9.640	273,776.000	
TBEA CO LTD	18,600	25.480	473,928.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	45,700	3.570	163,149.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	71,300	7.900	563,270.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	17,700	19.180	339,486.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	48.200	159,060.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	30.860	212,934.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	18.850	280,865.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.950	135,485.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	22.600	187,580.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	8.850	130,980.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	12.080	286,296.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	18.120	206,568.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	12,600	41.510	523,026.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	11.490	334,359.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	11.990	91,124.000	

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	53,570	14.790	792,300.300	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	64,100	5.680	364,088.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	6.940	195,708.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	18.400	370,208.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	35.280	268,128.000	
BBMG CORP	54,200	2.780	150,676.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	7,500	42.800	321,000.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	4.640	179,104.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	15.060	226,186.140	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	17.400	133,980.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	7,896	42.900	338,738.400	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	19.300	313,625.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	21.700	71,610.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.470	211,569.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	3.090	182,310.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	42.400	432,480.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	13.980	264,222.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.660	170,496.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	42.030	193,338.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.910	116,088.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.790	188,726.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	7.240	141,904.000	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,900	317.350	920,315.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	4,680	286.970	1,343,019.600	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	14.390	17,268.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	9.720	243,000.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	12.270	249,081.000	

PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	15.490	300,506.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.660	95,892.000	
BEIJING TIANAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	23.240	125,496.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	18.680	235,368.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	11.020	287,622.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	28.330	118,986.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE CO LTD	33,900	11.270	382,053.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	18.780	109,487.400	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.260	144,668.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	16.400	73,800.000	
TONGWEI CO LTD	18,500	53.530	990,305.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	6,830	53.980	368,683.400	
JCET GROUP CO LTD	10,900	24.350	265,415.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	46.550	316,540.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	124.820	312,050.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	51.690	273,957.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	18.590	104,104.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	29.770	312,287.300	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	183.870	312,579.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	16.500	334,059.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	2,900	24.290	70,441.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	5,924	53.620	317,644.880	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	10.930	214,228.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	12.790	250,684.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	17.270	271,139.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	146.080	248,336.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	42.200	206,780.000	

HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	43.010	240,856.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,400	129.050	180,670.000	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	197.100	177,390.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	800	207.540	166,032.000	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	62.960	163,696.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,000	140.510	140,510.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	59.740	424,154.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	62.700	695,970.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	121,500	6.360	772,740.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	32,268	61.060	1,970,284.080	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	15.650	198,755.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	155.800	280,440.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	35,151	21.300	748,716.300	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	14,216	79.960	1,136,711.360	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	47.710	238,550.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	13.450	16,140.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,000	53.940	269,700.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.640	114,048.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	59.500	416,500.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	14.980	609,686.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	6.980	416,706.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	55.410	188,394.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	61.000	323,300.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,000	95.800	191,600.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	6.680	555,776.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	13.840	326,624.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	20.430	232,902.000	

	SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	19.580	39,160.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	9,600	21.760	208,896.000	
	JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	60.180	90,270.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	9.370	284,848.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	144.900	115,920.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	3,900	18.390	71,721.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,480	76.340	418,343.200	
	TOLY BREAD CO LTD	7,056	15.470	109,156.320	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	47.370	135,478.200	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	46.900	137,886.000	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	8,700	26.830	233,421.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	9.910	192,254.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.690	251,040.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	49.430	222,435.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	24.290	259,903.000	
	オフショア・人民元 小計	9,214,807		159,051,435.120 (3,174,857,507)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	306,211	19.900	6,093,598.900	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	137,382	7.135	980,220.570	
	OOREDOO QSC	43,816	7.874	345,007.180	
	QATAR FUEL QSC	29,591	18.070	534,709.370	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	27,176	18.450	501,397.200	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	47,292	11.450	541,493.400	
	INDUSTRIES QATAR QSC	101,419	17.830	1,808,300.770	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	113,117	22.500	2,545,132.500	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	145,382	3.900	566,989.800	
	MASRAF AL RAYAN	390,973	4.707	1,840,309.910	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.500	484,571.500	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	315,284	2.753	867,976.850	
	カタール・リアル 小計	1,796,092		17,109,707.950 (632,374,806)	

クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	339,377	0.829	281,343.530	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	140,459	0.601	84,415.850	
	GULF BANK KSCP	107,039	0.311	33,289.120	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	478,921	1.015	486,104.810	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	79,998	1.111	88,877.770	
	MABANEE CO KPSC	33,481	0.781	26,148.660	
	BOUBYAN BANK KSCP	93,708	0.785	73,560.780	
クウェート・ディナール 小計	1,272,983		1,073,740.520 (473,401,458)		
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	28,480	22,190.000	631,971,200.000	
	ECOPETROL SA	312,678	3,150.000	984,935,700.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,683	43,500.000	769,210,500.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	32,245	39,100.000	1,260,779,500.000	
コロンビア・ペソ 小計	391,086		3,646,896,900.000 (125,063,035)		
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	17,311	55.000	952,105.000	
	JARIR MARKETING CO	3,870	151.000	584,370.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	26,902	37.650	1,012,860.300	
	SAUDI BRITISH BANK	63,576	40.150	2,552,576.400	
	AL RAJHI BANK	129,980	93.100	12,101,138.000	
	ARAB NATIONAL BANK	41,665	30.800	1,283,282.000	
	BANK ALBILAD	33,589	47.850	1,607,233.650	
	BANK AL-JAZIRA	26,450	25.900	685,055.000	
	BANQUE SAUDI FRANSI	40,443	49.800	2,014,061.400	
	RIYAD BANK	91,717	35.850	3,288,054.450	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	31,451	19.640	617,697.640	
	SAUDI TELECOM CO	39,225	107.000	4,197,075.000	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	14,886	147.400	2,194,196.400	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	59,330	110.600	6,561,898.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	59,259	23.800	1,410,364.200	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	22,202	28.800	639,417.600	
	SAVOLA GROUP	15,273	36.000	549,828.000	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	26,550	18.000	477,900.000	
	ALMARAI CO JSC	16,797	53.000	890,241.000	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	2,116	232.800	492,604.800	
EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	10.420	295,000.620		
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	22,410	51.000	1,142,910.000		

	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,008	55.100	551,440.800	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	52,637	16.300	857,983.100	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	13.380	414,927.180	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	12,965	20.800	269,672.000	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	35,907	12.760	458,173.320	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	4,552	160.000	728,320.000	
	ALINMA BANK	67,194	35.200	2,365,228.800	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	58,989	58.300	3,439,058.700	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,258	206.800	673,754.400	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	159,453	39.200	6,250,557.600	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	5,877	200.600	1,178,926.200	
	ACWA POWER CO	4,910	145.000	711,950.000	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	2,088	209.200	436,809.600	
	ELM CO	1,519	267.200	405,876.800	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	145,313	70.000	10,171,910.000	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,408,994		74,464,457.960 (2,683,699,065)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	90,400	34.500	3,118,800.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	221,800	15.800	3,504,440.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	81,200	39.000	3,166,800.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	685,755	4.620	3,168,188.100	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	18,400	177.000	3,256,800.000	
	SHIN CORP PCL	72,800	70.000	5,096,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	246,300	26.250	6,465,375.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	82,400	208.000	17,139,200.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	413,820	14.000	5,793,480.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	18,900	317.000	5,991,300.000	
	PTT PCL	646,700	37.500	24,251,250.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	166,500	17.100	2,847,150.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	59,100	61.250	3,619,875.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	647,000	8.600	5,564,200.000	

	SIAM CEMENT PCL NVDR	49,850	363.000	18,095,550.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	276,100	68.750	18,981,875.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	130,400	61.500	8,019,600.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	715,700	24.800	17,749,360.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	27,700	175.000	4,847,500.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	218,110	35.250	7,688,377.500	
	THAI OIL PCL NVDR	78,200	56.750	4,437,850.000	
	CP ALL PCL NVDR	393,400	63.500	24,980,900.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	589,700	8.500	5,012,450.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	94,845	173.000	16,408,185.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	113,322	51.250	5,807,752.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	149,708	47.250	7,073,703.000	
	JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	38,600	73.500	2,837,100.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	112,400	88.250	9,919,300.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	598,300	9.000	5,384,700.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	34.750	1,966,850.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	187,300	48.000	8,990,400.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	94,400	34.000	3,209,600.000	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	18.700	1,969,110.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	475,000	4.940	2,346,500.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	112,033	36.250	4,061,196.250	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	86,000	56.750	4,880,500.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	35,900	53.000	1,902,700.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	27.000	5,308,200.000	
	SCB X PCL NVDR	63,800	111.500	7,113,700.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	24,000	107.000	2,568,000.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	57,900	47.750	2,764,725.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	65.250	3,203,775.000	
	タイ・パーツ 小計	8,581,343		300,512,317.350 (1,162,982,668)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,530	702.000	3,180,060.000	
	CEZ	11,004	1,189.000	13,083,756.000	
	MONETA MONEY BANK AS	25,508	78.800	2,010,030.400	

チェコ・コルナ 小計		41,042		18,273,846.400 (104,732,896)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	4,435,043	39.350	174,518,942.050	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,095	30,240.000	93,592,800.000	
	BANCO DE CHILE	3,180,097	82.300	261,721,983.100	
	EMPRESAS CMPC SA	63,023	1,459.500	91,982,068.500	
	EMPRESAS COPEC SA	28,473	6,800.000	193,616,400.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,516	5,745.000	60,414,420.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	886,464	96.100	85,189,190.400	
	ENEL AMERICAS SA	1,435,310	89.450	128,388,479.500	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,589	81,600.000	782,462,400.000	
	FALABELLA SA	48,873	2,145.000	104,832,585.000	
	CENCOSUD SA	103,148	1,350.000	139,249,800.000	
	ENEL CHILE SA	2,415,702	23.970	57,904,376.940	
チリ・ペソ 小計		12,619,333		2,173,873,445.490 (347,202,371)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	224,367	8.520	1,911,606.840	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	23.240	1,043,429.520	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	89,195	33.240	2,964,841.800	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	297.500	1,388,730.000	
	KOC HOLDING AS	46,635	38.320	1,787,053.200	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	74,182	22.220	1,648,324.040	
	TURK HAVA YOLLARI	32,175	46.700	1,502,572.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	100,427	17.930	1,800,656.110	
	TURKIYE IS BANKASI	91,135	10.870	990,637.450	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	6,976	269.000	1,876,544.000	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	61,411	19.500	1,197,514.500	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	34,730	81.500	2,830,495.000	
トルコ・リラ 小計		810,799		20,942,404.960 (164,073,272)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	8,272	6,800.000	56,249,600.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	27,041	2,662.000	71,983,142.000	
	OTP BANK NYRT	15,864	8,762.000	139,000,368.000	
ハンガリー・フォリント 小計		51,177		267,233,110.000 (95,068,713)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	456,700	30.000	13,701,000.000	

	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	113,330	49.700	5,632,501.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	118,070	92.600	10,933,282.000	
	AYALA CORP	15,373	655.000	10,069,315.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,995	2,364.000	4,716,180.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	72,460	202.000	14,636,920.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	216,890	51.650	11,202,368.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	31,110	201.000	6,253,110.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	107,365	50.850	5,459,510.250	
	BDO UNIBANK INC	134,413	126.000	16,936,038.000	
	PLDT INC	5,260	1,836.000	9,657,360.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	803,475	37.000	29,728,575.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	59,590	102.000	6,078,180.000	
	SM INVESTMENTS CORP	16,483	820.000	13,516,060.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	889,900	3.700	3,292,630.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,210	360.400	5,842,084.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	495.000	3,267,495.000	
	AC ENERGY CORP	462,519	7.560	3,496,643.640	
	MONDE NISSIN CORP	445,400	14.500	6,458,300.000	
	CONVERGE INFORMATION AND COMMUNICATIONS TECHNOLOGY SOLUTIONS INC	132,900	23.300	3,096,570.000	
	フィリピン・ペソ 小計	4,106,044		183,974,122.390 (468,784,461)	
ブラジル・リアル	BRF SA	41,392	15.000	620,880.000	
	VALE SA	266,389	84.560	22,525,853.840	
	RAIA DROGASIL SA	70,800	20.800	1,472,640.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	17,050	39.700	676,885.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	26,800	41.000	1,098,800.000	
	BANCO DO BRASIL SA	60,400	34.550	2,086,820.000	
	ITAUSA SA	305,488	8.890	2,715,788.320	
	GERDAU SA	78,030	27.460	2,142,703.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	247,810	32.910	8,155,427.100	
	VIBRA ENERGIA SA	77,300	17.410	1,345,793.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	321,612	29.650	9,535,795.800	
	CCR SA	78,720	13.050	1,027,296.000	
	WEG SA	109,344	24.000	2,624,256.000	
	BANCO BRADESCO SA PRAF	361,602	19.110	6,910,214.220	
	BANCO BRADESCO SA	100,592	15.910	1,600,418.720	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	50,506	19.630	991,432.780	
	SUZANO SA	51,175	51.690	2,645,235.750	

	CPFL ENERGIA SA	16,300	31.930	520,459.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	323,247	24.100	7,790,252.700	
	AMERICANAS SA	46,471	15.220	707,288.620	
	BRASKEM SA	12,300	44.090	542,307.000	
	ENGIE BRASIL SA	10,987	40.920	449,588.040	
	LOCALIZA RENT A CAR	39,789	51.770	2,059,876.530	
	LOJAS RENNER SA	68,520	24.080	1,649,961.600	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	49,404	12.750	629,901.000	
	COSAN SA	78,100	19.740	1,541,694.000	
	TOTVS SA	34,300	26.230	899,689.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	67,700	24.160	1,635,632.000	
	JBS SA	55,500	34.780	1,930,290.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	96,362	10.920	1,052,273.040	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	25,198	43.050	1,084,773.900	
	HYPERA SA	26,000	38.900	1,011,400.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	406,548	11.660	4,740,349.680	
	MAGAZINE LUIZA SA	208,600	2.900	604,940.000	
	HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	46,800	27.100	1,268,280.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	32,728	46.800	1,531,670.400	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,000	24.600	1,107,000.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	312,661	6.010	1,879,092.610	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	17.830	533,117.000	
	AMBEV SA	307,495	13.590	4,178,857.050	
	NATURA &CO HOLDING SA	63,000	15.650	985,950.000	
	TIM SA	54,900	12.790	702,171.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	27,200	33.200	903,040.000	
	RUMO SA	82,200	17.460	1,435,212.000	
	ブラジル・リアル 小計	4,832,220		111,551,306.500 (3,019,348,058)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	634	250.200	158,626.800	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,027	140.100	1,404,782.700	
	BANK PEKAO SA	11,752	83.440	980,586.880	
	ORANGE POLSKA SA	52,852	5.778	305,378.850	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	21,150	70.760	1,496,574.000	
	LPP SA	76	9,950.000	756,200.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,326	228.800	532,188.800	
	CD PROJEKT RED SA	4,466	93.630	418,151.580	

	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	59,681	28.970	1,728,958.570	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	113,812	5.900	671,490.800	
	CYFROWY POLSAT SA	19,008	19.160	364,193.280	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	10.270	536,011.840	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	41,019	29.390	1,205,548.410	
	DINO POLSKA SA	3,219	303.800	977,932.200	
	ALLEGRO.EU SA	24,068	21.200	510,241.600	
	ポーランド・ズロチ 小計	416,282		12,046,866.310 (369,626,771)	
マレーシア・リ ンギット	AMMB HOLDINGS BHD	104,400	3.820	398,808.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	463,500	5.040	2,336,040.000	
	DIGI.COM BHD	208,500	3.170	660,945.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	47,920	6.620	317,230.400	
	RHB BANK BHD	100,280	5.900	591,652.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	7.300	231,410.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	332,800	1.130	376,064.000	
	GENTING BHD	147,700	4.860	717,822.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,056	19.200	346,675.200	
	HONG LEONG BANK BHD	43,208	20.800	898,726.400	
	IOI CORP BHD	168,913	4.090	690,854.170	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	27,000	24.980	674,460.000	
	MALAYAN BANKING BHD	305,875	8.750	2,676,406.250	
	MISC BHD	91,580	7.200	659,376.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	132.300	542,430.000	
	PPB GROUP BHD	42,860	15.880	680,616.800	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	21,400	21.060	450,684.000	
	PETRONAS GAS BHD	52,000	16.440	854,880.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	205,100	2.970	609,147.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	5.050	300,475.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	168,050	8.660	1,455,313.000	
	QL RESOURCES BHD	75,050	5.100	382,755.000	
	DIALOG GROUP BHD	278,044	2.170	603,355.480	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	956,450	4.530	4,332,718.500	
	SIME DARBY BERHAD	200,700	2.200	441,540.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	105,800	3.600	380,880.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	211,200	2.960	625,152.000	
	MAXIS BHD	167,000	3.390	566,130.000	
	INARI AMERTRON BHD	156,300	2.720	425,136.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	167,100	9.700	1,620,870.000	

	IHH HEALTHCARE BHD	117,100	6.450	755,295.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	253,300	4.990	1,263,967.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	159,100	4.640	738,224.000	
	MR DIY GROUP M BHD	105,600	3.200	337,920.000	
マレーシア・リンギット 小計		5,597,186		28,943,958.200 (885,760,375)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	201,200	13.720	2,760,464.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	85,600	61.400	5,255,840.000	
	GRUMA SAB DE CV	15,765	235.190	3,707,770.350	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	16,360	137.120	2,243,283.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	29,000	75.790	2,197,910.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	171,700	117.670	20,203,939.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	66,825	50.390	3,367,311.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,335	202.850	1,690,754.750	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	103,000	28.830	2,969,490.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	13,035	414.820	5,407,178.700	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	212,452	93.010	19,760,160.520	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,894,478	19.450	36,847,597.100	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	149,200	35.200	5,251,840.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	28,700	127.830	3,668,721.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	343,400	67.630	23,224,142.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	24,740	282.580	6,991,029.200	
OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	77,300	24.500	1,893,850.000		
メキシコ・ペソ 小計		3,441,090		147,441,281.570 (991,778,525)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	129,079	0.898	115,912.940	
	NATIONAL BANK OF GREECE	42,536	3.400	144,622.400	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,275	16.910	241,390.250	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	164,751	0.955	157,337.200	
	MYTILINEOS HOLDINGS	7,033	16.080	113,090.640	
	OPAP SA	12,831	14.000	179,634.000	
	JUMBO SA	6,996	14.540	101,721.840	
	PUBLIC POWER CORP	13,672	5.640	77,110.080	
ユーロ 小計		394,303		1,130,819.350	

(159,988,322)

韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,361	163,000.000	221,843,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,014	24,500.000	122,843,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,226	91,900.000	204,569,400.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,160	198,000.000	427,680,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,097	63,400.000	196,349,800.000	
	COWAY CO LTD	3,558	65,800.000	234,116,400.000	
	KT&G CORP	6,998	83,800.000	586,432,400.000	
	S-1 CORPORATION	1,557	66,400.000	103,384,800.000	
	CJ CORP	1,001	82,300.000	82,382,300.000	
	KAKAO CORP	20,613	80,100.000	1,651,101,300.000	
	CJ ENM CO LTD	761	112,800.000	85,840,800.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,988	55,800.000	110,930,400.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	18,739	7,610.000	142,603,790.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,123	457,000.000	513,211,000.000	
	LG UPLUS CORP	14,448	13,600.000	196,492,800.000	
	DOOSAN ENERBILITY	27,596	19,150.000	528,463,400.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	665	672,000.000	446,880,000.000	
	LG CHEM LTD	3,318	583,000.000	1,934,394,000.000	
	LG CHEM LTD	499	275,000.000	137,225,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	102	377,000.000	38,454,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	30,618	42,200.000	1,292,079,600.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	18,660	29,450.000	549,537,000.000	
	S-OIL CORP	3,203	121,500.000	389,164,500.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	7,252	40,650.000	294,793,800.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	17,730	5,510.000	97,692,300.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,220	38,400.000	162,048,000.000	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,740	130,500.000	227,070,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,038	207,000.000	214,866,000.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	2,459	77,300.000	190,080,700.000	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,944	92,100.000	271,142,400.000	
	HYUNDAI MOBIS	4,052	217,500.000	881,310,000.000	
	SK HYNIX INC	36,324	103,500.000	3,759,534,000.000	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,807	42,500.000	246,797,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	91,200.000	138,168,000.000		
HYUNDAI MOTOR CO	9,213	184,500.000	1,699,798,500.000		
HYUNDAI STEEL CO	5,729	40,550.000	232,310,950.000		

INDUSTRIAL BANK OF KOREA	17,601	10,850.000	190,970,850.000	
KIA CORPORATION	17,377	82,400.000	1,431,864,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	617	557,000.000	343,669,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	17,026	22,700.000	386,490,200.000	
KOREAN AIR CO LTD	11,593	27,900.000	323,444,700.000	
CJ LOGISTICS	393	120,500.000	47,356,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,199	163,000.000	195,437,000.000	
HLB INC	5,992	37,400.000	224,100,800.000	
LG ELECTRONICS INC	7,139	100,500.000	717,469,500.000	
LG CORP	6,127	80,800.000	495,061,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	10,150.000	93,004,450.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,422	38,200.000	168,920,400.000	
NAVER CORP	8,664	270,000.000	2,339,280,000.000	
L&F CO LTD	1,405	236,800.000	332,704,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,661	69,100.000	183,875,100.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,234	42,700.000	95,391,800.000	
KANGWON LAND INC	6,830	28,350.000	193,630,500.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,258	279,000.000	1,466,982,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,667	24,450.000	285,258,150.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,653	560,000.000	2,045,680,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	3,750	151,000.000	566,250,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	178,500.000	73,185,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	318,493	63,800.000	20,319,853,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	45,966	5,970.000	274,417,020.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	54,475	58,500.000	3,186,787,500.000	
YUHAN CORP	3,380	57,200.000	193,336,000.000	
HANON SYSTEMS	12,332	11,050.000	136,268,600.000	
GS HOLDINGS CORP	2,622	47,550.000	124,676,100.000	
LG DISPLAY CO LTD	15,215	17,000.000	258,655,000.000	
CELLTRION INC	6,755	159,500.000	1,077,422,500.000	
HANA FINANCIAL GROUP	19,929	46,000.000	916,734,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,138	195,500.000	222,479,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,017	80,000.000	81,360,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,025	104,000.000	106,600,000.000	
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	2,499	36,700.000	91,713,300.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,182	65,100.000	337,348,200.000	
AMOREPACIFIC CORP	1,790	153,000.000	273,870,000.000	

SK INNOVATION CO LTD	3,712	244,000.000	905,728,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	480	377,000.000	180,960,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,613	6,980.000	129,918,740.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,009	378,000.000	381,402,000.000	
SK INC	2,536	246,500.000	625,124,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	26,148	55,400.000	1,448,599,200.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	4,341	58,100.000	252,212,100.000	
ILJIN MATERIALS CO LTD	1,593	82,700.000	131,741,100.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	2,277	29,950.000	68,196,150.000	
HANMI PHARM CO LTD	545	306,000.000	166,770,000.000	
SEEGENE INC	1,958	42,500.000	83,215,000.000	
E-MART CO LTD	1,426	113,500.000	161,851,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,028	36,750.000	184,779,000.000	
HD HYUNDAI CO LTD	3,223	65,200.000	210,139,600.000	
BGF RETAIL CO LTD	413	178,500.000	73,720,500.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,663	92,100.000	153,162,300.000	
SK CHEMICALS CO LTD	613	120,500.000	73,866,500.000	
NETMARBLE CORP	1,478	80,900.000	119,570,200.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	35,234	14,750.000	519,701,500.000	
ECOPRO BM CO LTD	844	511,900.000	432,043,600.000	
SD BIOSENSOR INC	2,353	43,300.000	101,884,900.000	
ECOPRO BM CO LTD-RTS	33	124,600.000	4,111,800.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,002	81,000.000	162,162,000.000	
KRAFTON INC	1,699	274,000.000	465,526,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,087	138,000.000	150,006,000.000	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,874	114,500.000	214,573,000.000	
SK SQUARE CO LTD	6,686	45,600.000	304,881,600.000	
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,444	121,000.000	174,724,000.000	
KAKAO GAMES CORP	2,243	60,400.000	135,477,200.000	
HYBE CO LTD	1,036	223,500.000	231,546,000.000	
LG ENERGY SOLUTION	1,408	425,000.000	598,400,000.000	
KAKAObANK CORP	8,354	39,150.000	327,059,100.000	
F&F CO LTD / NEW	1,052	130,500.000	137,286,000.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,501	142,500.000	356,392,500.000	
ALTEOGEN INC	2,026	51,900.000	105,149,400.000	
SAMSUNG C&T CORP	5,566	116,500.000	648,439,000.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,164	811,000.000	944,004,000.000	
PEARL ABYSS CORP	2,080	62,000.000	128,960,000.000	
DOOSAN BOBCAT INC	2,805	36,050.000	101,120,250.000	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,026	61,100.000	368,188,600.000	
韓国・ウォン 小計	1,072,900		70,375,729,650.000	

(7,396,489,186)

香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	12.540	840,180.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	7.810	702,900.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	152,000	4.120	626,240.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	117.290	750,656.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	87,500	33.250	2,909,375.000	
	BEIJING ENTERPRISES	40,000	27.850	1,114,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	280,000	3.610	1,010,800.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	278,000	5.070	1,409,460.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	96,000	28.000	2,688,000.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	51,590	12.460	642,811.400	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	47,000	37.150	1,746,050.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	0.000	0.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	607,600	7.410	4,502,316.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	263,620	22.100	5,826,002.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	218,888	33.400	7,310,859.200	
	CITIC LTD	392,000	8.650	3,390,800.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	164,000	4.570	749,480.000	
	LENOVO GROUP LTD	486,000	7.750	3,766,500.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,432,000	4.310	6,171,920.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	99,190	9.260	918,499.400	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,699,200	3.710	6,304,032.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	56,000	13.180	738,080.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	177,000	16.940	2,998,380.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	52,900	120.700	6,385,030.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	250,000	6.580	1,645,000.000	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	150,000	6.010	901,500.000	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	101,200	8.280	837,936.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	94,000	13.600	1,278,400.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	244,000	3.460	844,240.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	76,000	24.750	1,881,000.000	

SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	74,500	7.530	560,985.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	218,400	12.000	2,620,800.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	42,500	38.950	1,655,375.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	406,000	15.360	6,236,160.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	63,700	35.250	2,245,425.000	
BYD CO LTD	54,000	315.800	17,053,200.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	9.670	1,141,060.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	680,000	0.770	523,600.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	283,592	4.550	1,290,343.600	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	170,000	7.680	1,305,600.000	
MMG LTD	184,000	3.540	651,360.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	9,000	235.400	2,118,600.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	469,788	8.040	3,777,095.520	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	4.340	585,900.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	123,200	14.440	1,779,008.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	204,000	15.520	3,166,080.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	510,000	12.260	6,252,600.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	375,000	10.720	4,020,000.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	188,800	8.100	1,529,280.000	
WEICHAI POWER CO LTD	127,440	12.480	1,590,451.200	
TINGYI HOLDING CORP	140,000	13.520	1,892,800.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	36,000	69.950	2,518,200.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	212,000	9.560	2,026,720.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	174,000	4.000	696,000.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	109,333	50.300	5,499,449.900	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	7.120	825,920.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	721,250	4.230	3,050,887.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	209,000	37.500	7,837,500.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	416,600	396.400	165,140,240.000	

PING AN INSURANCE GROUP CO-H	422,000	48.450	20,445,900.000	
LI NING CO LTD	156,500	65.350	10,227,275.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	280,000	2.550	714,000.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	349,000	4.040	1,409,960.000	
AIR CHINA / HONG KONG	132,000	5.530	729,960.000	
ZTE CORP	44,288	17.120	758,210.560	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	232,000	27.200	6,310,400.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	213,250	13.040	2,780,780.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	556,205	5.190	2,886,703.950	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	124,250	8.820	1,095,885.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	51,000	17.740	904,740.000	
BAIDU INC	149,050	149.900	22,342,595.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,389,530	5.590	35,717,472.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	55,400	104.500	5,789,300.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	194,000	6.200	1,202,800.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	20.350	895,400.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	108,000	6.920	747,360.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	278,000	8.550	2,376,900.000	
BANK OF CHINA LTD	5,246,200	3.070	16,105,834.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	13.600	816,000.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	256,470	48.900	12,541,383.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,747,235	4.550	17,049,919.250	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	74,000	7.060	522,440.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	14.280	763,980.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.590	601,684.000	
CHINA COAL ENERGY CO	149,000	7.850	1,169,650.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	51,000	21.200	1,081,200.000	
ZHUZHOU CRRIC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,300	35.200	1,312,960.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	578,142	4.640	2,682,578.880	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	237,000	4.340	1,028,580.000	

CHINA CITIC BANK-H	568,800	3.810	2,167,128.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	48,000	118.300	5,678,400.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	80,600	91.600	7,382,960.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	17.900	358,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	184,528	7.630	1,407,948.640	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	306,000	2.070	633,420.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	218,000	4.250	926,500.000	
KINGSOFT CORP LTD	67,600	31.550	2,132,780.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	34,000	11.020	374,680.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	314,000	5.070	1,591,980.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	88,000	6.240	549,120.000	
DONGYUE GROUP	116,000	10.720	1,243,520.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	47,500	20.600	978,500.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	341,000	7.250	2,472,250.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	184,000	17.560	3,231,040.000	
CRRG CORP LTD - H	349,000	3.090	1,078,410.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	76,000	12.800	972,800.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	107,000	11.400	1,219,800.000	
SINOPHARM GROUP CO	99,200	18.380	1,823,296.000	
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY CORP LTD	125,000	4.610	576,250.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	136,000	5.290	719,440.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	186,527	7.860	1,466,102.220	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	9.650	1,452,325.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	224,000	15.860	3,552,640.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	46,600	12.780	595,548.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	107,200	4.280	458,816.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	60,000	7.710	462,600.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	126,500	33.350	4,218,775.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	59,700	21.250	1,268,625.000	

CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	472,656	3.050	1,441,600.800	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	48,000	12.620	605,760.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	74,000	10.320	763,680.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.580	645,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,901,000	2.930	5,569,930.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	37,500	60.000	2,250,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	7.470	769,410.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	44,600	17.620	785,852.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	131,000	17.120	2,242,720.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	98,000	3.360	329,280.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	194,000	5.710	1,107,740.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	554,000	2.530	1,401,620.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	32,000	31.100	995,200.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	278,000	3.540	984,120.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	216,500	4.490	972,085.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	108,000	8.170	882,360.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	548,000	5.930	3,249,640.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	30,000	24.650	739,500.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	26.400	1,953,600.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	140,000	30.200	4,228,000.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	33,000	22.350	737,550.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	13.680	513,000.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	44,250	13.320	589,410.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,152,000	0.960	3,025,920.000	
XIAOMI CORP	1,023,000	12.180	12,460,140.000	

WUXI APPTTEC CO LTD	22,712	105.400	2,393,844.800	
MEITUAN	273,400	201.200	55,008,080.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	71,200	15.420	1,097,904.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	76,000	15.700	1,193,200.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	324,000	14.240	4,613,760.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	75,500	26.750	2,019,625.000	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	62,000	9.470	587,140.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	640,000	1.330	851,200.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	36,000	27.100	975,600.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	2.180	224,540.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	17.700	1,814,250.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	107,500	6.180	664,350.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	6,200	83.200	515,840.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	116,000	6.470	750,520.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	76,000	13.500	1,026,000.000	
CHINA FEIHE LTD	248,000	8.160	2,023,680.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,014,568	112.800	114,443,270.400	
PHARMARON BEIJING CO LTD	13,600	71.550	973,080.000	
JD.COM INC	134,435	250.800	33,716,298.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	125,000	20.700	2,587,500.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	17.960	898,000.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	117,700	86.500	10,181,050.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	151,000	25.750	3,888,250.000	
BILIBILI INC	12,680	219.800	2,787,064.000	
NETEASE INC	138,300	172.500	23,856,750.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	65,000	11.460	744,900.000	
GDS HOLDINGS LTD	61,700	32.050	1,977,485.000	
NONGFU SPRING CO LTD	117,000	41.800	4,890,600.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	77,650	55.500	4,309,575.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	22,000	45.250	995,500.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	43,000	39.400	1,694,200.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,800	83.400	733,920.000	

	CHINA VANKE CO LTD-H	106,561	17.200	1,832,849.200	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	116,300	12.800	1,488,640.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	32,800	35.600	1,167,680.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	37,000	29.550	1,093,350.000	
	CGN POWER CO LTD	609,000	1.950	1,187,550.000	
	GF SECURITIES CO LTD	68,200	10.480	714,736.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	39,200	41.850	1,640,520.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	92,400	11.520	1,064,448.000	
	3SBIO INC	90,500	6.480	586,440.000	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	37.300	1,059,320.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	31,000	33.850	1,049,350.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	3.970	581,605.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	105,000	8.980	942,900.000	
	BOC AVIATION LTD	16,400	64.500	1,057,800.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	41,100	27.300	1,122,030.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	74,000	15.300	1,132,200.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	108,000	15.780	1,704,240.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	240,000	69.000	16,560,000.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	264,000	2.610	689,040.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	17,600	111.600	1,964,160.000	
香港・ドル	小計	57,068,778		916,805,545.120 (15,769,055,375)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	34,000	242.000	8,228,000.000	
	ACER INC	212,532	27.950	5,940,269.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	44,554	329.000	14,658,266.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	29,616	445.500	13,193,928.000	
	ASIA CEMENT CORP	149,928	44.150	6,619,321.200	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	62,000	101.500	6,293,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	45,000	133.000	5,985,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	84,000	206.500	17,346,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	175,858	80.400	14,138,983.200	
	EVA AIRWAYS CORP	164,000	32.850	5,387,400.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	48,760	168.000	8,191,680.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	308,208	17.900	5,516,923.200	
	CHINA AIRLINES	176,000	25.950	4,567,200.000	

CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	122,169	35.500	4,336,999.500	
CHINA STEEL CORP	803,058	34.500	27,705,501.000	
ADVANTECH CO LTD	27,675	346.500	9,589,387.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	296,304	23.000	6,814,992.000	
DELTA ELECTRONICS INC	126,663	237.000	30,019,131.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	83,000	65.100	5,403,300.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	247,427	125.000	30,928,375.000	
AU OPTRONICS CORP	563,194	17.750	9,996,693.500	
TAIWAN MOBILE CO LTD	112,800	106.500	12,013,200.000	
EVERGREEN MARINE CORP	173,820	139.000	24,160,980.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	196,824	31.300	6,160,591.200	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	28,768	199.500	5,739,216.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	13,322	501.000	6,674,322.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	37,285	393.000	14,653,005.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	280,633	107.500	30,168,047.500	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	230,594	82.500	19,024,005.000	
GIANT MANUFACTURING	20,151	252.500	5,088,127.500	
MEDIATEK INC	100,507	930.000	93,471,510.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	465,942	62.900	29,307,751.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	581,752	23.200	13,496,646.400	
HOTAI MOTOR CO LTD	19,000	610.000	11,590,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	114,000	80.700	9,199,800.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	619,146	23.450	14,518,973.700	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	524,941	54.800	28,766,766.800	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,046,011	15.850	16,579,274.350	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	824,798	29.150	24,042,861.700	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	827,225	114.000	94,303,650.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	717,495	37.100	26,619,064.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	1,810.000	11,258,200.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	692,132	17.150	11,870,063.800	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	912,345	9.380	8,557,796.100	
INVENTEC CO LTD	194,005	25.450	4,937,427.250	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	134,845	62.400	8,414,328.000	

SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	696,443	17.200	11,978,819.600	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,185,048	26.000	30,811,248.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	689,806	26.200	18,072,917.200	
NAN YA PLASTICS CORP	314,828	84.700	26,665,931.600	
POU CHEN CORP	168,990	31.250	5,280,937.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	311,297	64.600	20,109,786.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	39,392	264.000	10,399,488.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	72,480	96.000	6,958,080.000	
E INK HOLDINGS INC	59,000	219.000	12,921,000.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	76,224	78.500	5,983,584.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	94,899	61.300	5,817,308.700	
TAIWAN CEMENT CORP	355,171	41.400	14,704,079.400	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,643,083	530.000	870,833,990.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	784,525	51.200	40,167,680.000	
WAN HAI LINES LTD	39,500	150.000	5,925,000.000	
WALSIN LIHWA CORP	149,000	43.150	6,429,350.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	220,000	27.850	6,127,000.000	
YAGEO CORP	29,160	400.000	11,664,000.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	120,000	126.000	15,120,000.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	138,000	27.800	3,836,400.000	
INNOLUX CORPORATION	684,345	13.900	9,512,395.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	105,203	57.100	6,007,091.300	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	15,000	365.000	5,475,000.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	4,000	1,435.000	5,740,000.000	
PEGATRON CORP	134,554	68.700	9,243,859.800	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,371	1,015.000	9,511,565.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	23,000	228.000	5,244,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	86,593	223.500	19,353,535.500	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,000	1,495.000	7,475,000.000	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,385.000	2,770,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	49,385	116.500	5,753,352.500	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	624,393	27.150	16,952,269.950	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	237,993	52.100	12,399,435.300	

	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	4,000	1,420.000	5,680,000.000	
	WIWYNN CORP	5,000	900.000	4,500,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	217,903	105.000	22,879,815.000	
	SILERGY CORP	5,000	2,795.000	13,975,000.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	184,000	55.800	10,267,200.000	
	MOMO.COM INC	3,000	827.000	2,481,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	617.000	8,021,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	11,000	341.000	3,751,000.000	
台湾・ドル	小計	22,289,093		2,088,275,079.150 (9,533,184,564)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	233.500	1,672,560.500	
	BIDVEST GROUP LTD	19,373	212.230	4,111,531.790	
	CLICKS GROUP LTD	15,256	279.950	4,270,917.200	
	DISCOVERY LTD	33,035	134.090	4,429,663.150	
	GOLD FIELDS LTD	61,862	156.500	9,681,403.000	
	REMGRO LTD	34,581	136.500	4,720,306.500	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	20,765	133.240	2,766,728.600	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	36,308	51.950	1,886,200.600	
	EXXARO RESOURCES LTD	15,424	201.900	3,114,105.600	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	5,750	2,061.260	11,852,245.000	
	MTN GROUP LTD	114,341	146.540	16,755,530.140	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	29,196	267.600	7,812,849.600	
	FIRSTRAND LTD	335,817	65.630	22,039,669.710	
	NASPERS LTD	14,541	1,773.160	25,783,519.560	
	NEDBANK GROUP LTD	30,397	215.760	6,558,456.720	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,490	1,486.540	5,188,024.600	
	SASOL LTD	38,668	411.670	15,918,455.560	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,039	209.280	7,123,681.920	
	MR PRICE GROUP LTD	17,098	186.610	3,190,657.780	
	STANDARD BANK GROUP LTD	89,166	155.580	13,872,446.280	
	SPAR GROUP LTD/THE	15,257	138.830	2,118,129.310	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	67,813	53.250	3,611,042.250	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	26,382	140.290	3,701,130.780	
	ABSA GROUP LTD	53,264	161.290	8,590,950.560	
	SANLAM LTD	117,672	57.680	6,787,320.960	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	56,479	179.080	10,114,259.320	
	KUMBA IRON ORE LTD	4,271	558.270	2,384,371.170	
	VODACOM GROUP PTY LTD	40,450	135.840	5,494,728.000	
	NEPI ROCKCASTLE SA	30,168	93.100	2,808,640.800	

	OLD MUTUAL LTD	299,244	12.010	3,593,920.440	
	REINET INVESTMENTS SCA	9,455	285.000	2,694,675.000	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	100,374	20.280	2,035,584.720	
	MULTICHOICE GROUP LTD	24,565	127.990	3,144,074.350	
	SIBANYE STILLWATER LTD	194,863	45.150	8,798,064.450	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	23,806	166.850	3,972,031.100	
	BID CORP LTD	21,703	320.000	6,944,960.000	
南アフリカ・ランド	小計	2,042,036		249,542,837.020 (2,108,636,973)	
合計		174,097,874		61,191,062,917 (61,191,062,917)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年6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	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	77,800.000	1,745,054.000	
		BANCO INTER SA	23,700.000	244,110.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	24,900.000	774,390.000	
		ENERGISA SA	12,500.000	530,500.000	
		KLABIN SA	49,100.000	1,048,776.000	
	ブラジル・レアル	小計	188,000.000	4,342,830.000 (117,546,945)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	991,375.000	7,762,466.250	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	34,700.000	3,875,990.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	128,900.000	18,231,616.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	157,800.000	5,530,890.000	
メキシコ・ペソ	小計	1,312,775.000	35,400,962.250 (238,128,113)		
投資信託受益証券	合計	1,500,775	355,675,058 (355,675,058)		
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	233,300.000	4,754,654.000	
		メキシコ・ペソ	小計	233,300.000	4,754,654.000 (31,982,656)
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	247,694.000	3,237,360.580	
		南アフリカ・ランド	小計	247,694.000	3,237,360.580 (27,355,697)
投資証券	合計	480,994	59,338,353 (59,338,353)		
合計			415,013,411 (415,013,411)		

(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 54銘柄	2.66	-	-	2.89
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 9銘柄	1.19	-	-	1.29
インド・ルピー	株式 109銘柄	11.65	-	-	12.67
インドネシア・ルピア	株式 25銘柄	1.70	-	-	1.85
オフショア・人民元	株式 399銘柄	4.74	-	-	5.15
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.94	-	-	1.03
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.71	-	-	0.77
コロンビア・ペソ	株式 4銘柄	0.19	-	-	0.20
サウジアラビア・リアル	株式 37銘柄	4.00	-	-	4.36
タイ・バーツ	株式 42銘柄	1.74	-	-	1.89
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.16	-	-	0.17
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.52	-	-	0.56
トルコ・リラ	株式 12銘柄	0.24	-	-	0.27
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.14	-	-	0.15
フィリピン・ペソ	株式 20銘柄	0.70	-	-	0.76
ブラジル・レアル	株式 44銘柄 投資信託受益証 券 5銘柄	4.50 -	- 0.18	- -	5.09
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.55	-	-	0.60
マレーシア・リンギット	株式 34銘柄	1.32	-	-	1.44
メキシコ・ペソ	株式 17銘柄 投資信託受益証 券 4銘柄 投資証券 1銘柄	1.48 - -	- 0.36 -	- - 0.05	2.05
ユーロ	株式 9銘柄	0.24	-	-	0.26
韓国・ウォン	株式 113銘柄	11.03	-	-	12.01
香港・ドル	株式 197銘柄	23.53	-	-	25.60
台湾・ドル	株式 87銘柄	14.22	-	-	15.47
南アフリカ・ランド	株式 36銘柄 投資証券 1銘柄	3.15 -	- -	- 0.04	3.47

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年6月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	18,961,306,121
コール・ローン	14,300,763,989
国債証券	140,352,082,164
派生商品評価勘定	82,831,594
未収利息	531,047,771
前払費用	855,532,629
流動資産合計	175,083,564,268
資産合計	175,083,564,268
負債の部	
流動負債	
未払金	31,383,147,600
未払解約金	46,882,000
流動負債合計	31,430,029,600
負債合計	31,430,029,600
純資産の部	
元本等	
元本	71,376,492,707
剰余金	
剰余金又は欠損金()	72,277,041,961
元本等合計	143,653,534,668
純資産合計	143,653,534,668
負債純資産合計	175,083,564,268

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12月14日 至 2022年6月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年6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	48,633,528,935円
同期中追加設定元本額	121,395,417,988円
同期中一部解約元本額	98,652,454,216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）	150,041,523円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,952,327,059円
たわらノーロード バランス（堅実型）	140,683,131円
たわらノーロード バランス（標準型）	395,926,910円
たわらノーロード バランス（積極型）	167,610,940円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,225,247円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	3,493,402円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	33,105,621円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,342,372円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,322,683円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	59,256,549円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	247,220,954円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	338,660,549円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	687,467,900円
投資のソムリエ	23,457,811,434円
クルーズコントロール	245,920,433円
投資のソムリエ<DC年金>	1,471,301,137円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	265,084,234円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,260,856,839円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,422,867,821円
ワールドアセットバランス（基本コース）	511,368,447円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	435,640,819円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	42,221,439円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	21,321,983円

リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	8,629,112円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	178,205,255円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	844,916,157円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	216,977,014円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	61,107,485円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	21,306,971円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	14,093,235円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	2,464,141円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	22,668,193,619円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	608,817,138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）	2,615,566,630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）	588,878,255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）	25,153,741円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	111,655,505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）	9,315,837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）	173,295,074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）	83,969,848円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,827,868,264円
計	71,376,492,707円
2. 受益権の総数	71,376,492,707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12月14日 至 2022年6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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年6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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月13日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	5,128,865,884	
合計	5,128,865,884	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年4月19日から2022年6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	2022年6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	14,000,000,000	-	14,082,831,594	82,831,594	
合計	14,000,000,000	-	14,082,831,594	82,831,594	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲

値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年6月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0126円 (20,126円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年6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	ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23	5,000,000.000	4,861,280.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	6,000,000.000	5,395,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	4,000,000.000	3,416,360.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	6,000,000.000	5,179,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	6,000,000.000	5,838,540.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	6,000,000.000	5,866,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	8,000,000.000	7,471,720.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	2,000,000.000	1,392,140.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	8,000,000.000	7,728,696.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	8,000,000.000	6,396,368.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 10/11/27	10,000,000.000	9,885,380.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	8,000,000.000	7,334,528.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 4.125 10/11/47	7,000,000.000	6,692,700.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	7,000,000.000	6,673,469.880	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	8,000,000.000	6,664,489.120	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	13,000,000.000	11,108,859.190	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	7,000,000.000	6,498,450.000	
BRAZIL 4.625 01/13/28	11,000,000.000	10,472,373.120			

BRAZIL 4.75 01/14/50	12,000,000.000	8,500,333.680	
BRAZIL 5.0 01/27/45	6,800,000.000	5,110,696.330	
BRAZIL 5.625 01/07/41	6,100,000.000	5,106,389.600	
BRAZIL 5.625 02/21/47	4,600,000.000	3,723,019.560	
BRAZIL 6.0 04/07/26	4,800,000.000	5,018,904.860	
BRAZIL 8.25 01/20/34	4,200,000.000	4,727,520.000	
BRAZIL 8.75 02/04/25	5,000,000.000	5,636,500.000	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,704,106.840	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,683,434.760	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	8,000,000.000	6,300,847.360	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	11,000,000.000	8,459,414.150	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	8,000,000.000	6,067,768.880	
COLOMBIA 3.875 02/15/61	4,000,000.000	2,417,936.600	
COLOMBIA 4.125 02/22/42	6,000,000.000	3,997,156.260	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	4,000,000.000	2,556,075.920	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,000,000.000	5,732,561.340	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	11,000,000.000	9,800,705.640	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	10,000,000.000	7,183,368.200	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	10,000,000.000	7,318,000.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	7,000,000.000	5,451,538.680	
CROATIA 5.5 04/04/23	6,400,000.000	6,503,539.200	
CROATIA 6.0 01/26/24	5,400,000.000	5,581,710.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	14,000,000.000	12,749,413.320	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	15,000,000.000	10,708,187.100	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	16,200,000.000	14,265,986.160	
HUNGARY 2.125 09/22/31	8,000,000.000	6,226,112.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	5,000,000.000	3,254,970.000	
HUNGARY 5.375 02/21/23	3,358,000.000	3,410,169.880	
HUNGARY 5.375 03/25/24	8,380,000.000	8,583,625.620	
HUNGARY 5.75 11/22/23	8,000,000.000	8,211,928.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	4,400,000.000	5,185,510.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	5,200,000.000	4,344,547.160	
INDONESIA 2.85 02/14/30	3,000,000.000	2,753,899.470	
INDONESIA 3.05 03/12/51	5,000,000.000	3,911,971.450	
INDONESIA 3.4 09/18/29	4,200,000.000	4,016,974.240	
INDONESIA 3.5 01/11/28	3,200,000.000	3,116,308.920	
INDONESIA 3.7 10/30/49	2,000,000.000	1,657,945.160	
INDONESIA 3.85 10/15/30	6,400,000.000	6,259,296.700	
INDONESIA 4.1 04/24/28	2,000,000.000	2,003,778.100	
INDONESIA 4.125 01/15/25	4,200,000.000	4,242,594.930	
INDONESIA 4.2 10/15/50	5,000,000.000	4,439,184.100	
INDONESIA 4.35 01/08/27	3,600,000.000	3,636,987.480	
INDONESIA 4.35 01/11/48	5,600,000.000	5,068,486.580	
INDONESIA 4.45 04/15/70	1,200,000.000	1,068,159.140	

INDONESIA 4.75 01/08/26	6,000,000.000	6,181,417.020	
INDONESIA 4.75 02/11/29	4,200,000.000	4,359,356.020	
INDONESIA 5.125 01/15/45	4,400,000.000	4,327,701.090	
INDONESIA 5.25 01/17/42	7,500,000.000	7,515,201.520	
INDONESIA 5.35 02/11/49	2,000,000.000	2,032,238.140	
INDONESIA 5.875 01/15/24	3,200,000.000	3,320,000.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,200,000.000	4,551,036.960	
INDONESIA 6.75 01/15/44	4,100,000.000	4,830,598.140	
INDONESIA 7.75 01/17/38	3,500,000.000	4,349,504.950	
PANAMA 2.252 09/29/32	14,000,000.000	11,145,805.300	
PANAMA 3.16 01/23/30	9,000,000.000	8,191,800.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	2,800,000.000	2,792,679.340	
PANAMA 3.87 07/23/60	8,000,000.000	5,877,393.840	
PANAMA 3.875 03/17/28	5,700,000.000	5,513,196.230	
PANAMA 4.5 01/19/63	4,000,000.000	3,237,630.320	
PANAMA 4.5 04/01/56	11,000,000.000	9,173,483.330	
PANAMA 4.5 04/16/50	11,300,000.000	9,652,197.950	
PANAMA 6.7 01/26/36	7,900,000.000	8,808,500.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	2,800,000.000	3,072,335.470	
PERU 1.862 12/01/32	6,000,000.000	4,658,544.120	
PERU 2.392 01/23/26	3,600,000.000	3,382,638.040	
PERU 2.78 12/01/60	8,000,000.000	5,183,784.880	
PERU 2.783 01/23/31	17,000,000.000	14,721,875.560	
PERU 2.844 06/20/30	3,000,000.000	2,665,210.740	
PERU 3.0 01/15/34	10,000,000.000	8,300,399.600	
PERU 3.3 03/11/41	7,000,000.000	5,417,762.210	
PERU 3.55 03/10/51	8,000,000.000	6,175,268.480	
PERU 5.625 11/18/50	6,000,000.000	6,474,542.160	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	8,600,000.000	7,111,470.630	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	8,800,000.000	7,880,104.760	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	6,000,000.000	4,365,000.000	
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	3,000,000.000	2,259,470.940	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	10,000,000.000	9,628,457.000	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	6,000,000.000	4,684,142.760	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	5,000,000.000	4,306,250.000	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	9,200,000.000	9,099,869.500	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	5,000,000.000	4,482,223.300	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	3,000,000.000	3,048,121.530	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	7,000,000.000	8,158,973.410	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	3,100,000.000	3,830,350.540	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	4,800,000.000	6,350,601.840	

REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	6,200,000.000	5,333,757.570	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	5,200,000.000	4,450,728.980	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	8,000,000.000	6,571,771.840	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	4,200,000.000	3,957,099.420	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	4,000,000.000	2,725,770.000	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	7,000,000.000	5,334,695.240	
REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	6,600,000.000	6,326,134.180	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	6,000,000.000	4,654,368.660	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	6,200,000.000	5,536,265.510	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	4,000,000.000	3,047,414.560	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	6,000,000.000	5,347,441.740	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	12,000,000.000	12,273,650.400	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	11,000,000.000	11,132,442.860	
ROMANIA 3.0 02/14/31	6,000,000.000	4,907,448.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	8,000,000.000	5,818,160.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,800,000.000	2,807,308.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	5,600,000.000	4,818,984.800	
ROMANIA 6.125 01/22/44	9,600,000.000	9,296,736.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	10,000,000.000	8,566,440.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.875 03/04/23	2,000,000.000	2,001,000.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	6,000,000.000	5,907,000.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	6,200,000.000	5,970,104.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	4,000,000.000	3,098,604.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.625 03/04/28	9,000,000.000	8,939,700.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	4,400,000.000	3,730,540.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	10,000,000.000	10,180,000.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	8,000,000.000	8,286,336.000	

SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	7,000,000.000	7,313,908.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	3,795,972.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.625 10/04/47	8,000,000.000	7,640,000.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	5,000,000.000	5,049,900.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	5,000,000.000	5,250,255.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	7,800,000.000	6,980,032.800	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	11,000,000.000	9,899,230.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,400,000.000	5,267,754.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	9,200,000.000	6,981,788.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	14,000,000.000	10,563,700.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	7,000,000.000	6,684,454.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,200,000.000	6,304,470.000	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,200,000.000	3,453,198.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	4,000,000.000	3,550,436.000	
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	8,000,000.000	8,029,600.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	9,000,000.000	9,000,000.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	10,000,000.000	10,067,100.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	12,000,000.000	12,299,208.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	11,000,000.000	10,842,700.000	
STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	9,000,000.000	9,482,400.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	12,000,000.000	12,504,564.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	13,000,000.000	14,051,700.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	4,000,000.000	3,188,400.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	10,000,000.000	8,350,710.200	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,348,953.860	

	UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	9,000,000.000	7,561,252.980	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	2,200,000.000	2,210,206.480	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	6,200,000.000	6,000,222.050	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,603,382.560	
	UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	8,000,000.000	5,366,632.640	
	UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	3,600,000.000	3,627,084.520	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	3,000,000.000	3,021,378.420	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	4,400,000.000	4,385,152.110	
	UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	8,000,000.000	6,473,086.080	
	UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	3,000,000.000	2,319,626.940	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	5,000,000.000	4,051,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	8,000,000.000	7,867,976.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,000,000.000	6,589,686.720	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	4,400,000.000	3,585,569.060	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	6,000,000.000	5,830,847.100	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	7,000,000.000	6,020,288.190	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	1,800,000.000	1,565,513.380	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,900,000.000	5,955,157.920	
	アメリカ・ドル 小計	1,153,238,000.000 (155,687,130,000)	1,039,645,053.070 (140,352,082,164)	
国債証券 合計		155,687,130,000 (155,687,130,000)	140,352,082,164 (140,352,082,164)	
合計			140,352,082,164 (140,352,082,164)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
----	-----	---------------------	----------------------------

アメリカ・ドル	国債証券	173銘柄	97.70	100.00
---------	------	-------	-------	--------

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2022年6月30日現在

資産総額	6,840,105,428円
負債総額	213,215,806円
純資産総額（ - ）	6,626,889,622円
発行済数量	6,700,353,156口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9890円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2022年6月30日現在

資産総額	22,030,596,559円
負債総額	166,208,712円
純資産総額（ - ）	21,864,387,847円
発行済数量	21,879,494,517口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9993円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	748,083,180,809円
負債総額	25,156,506,484円
純資産総額（ - ）	722,926,674,325円
発行済数量	124,420,591,892口
1口当たり純資産額（ / ）	5.8103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

2022年6月30日現在

資産総額	435,506,175,026円
負債総額	57,079,130,483円
純資産総額（ - ）	378,427,044,543円
発行済数量	298,606,515,187口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2673円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	76,917,680,989円
負債総額	10,385,872,283円
純資産総額（ - ）	66,531,808,706円
発行済数量	38,846,403,934口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7127円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	65,433,047,522円
負債総額	32,058,485円
純資産総額（ - ）	65,400,989,037円
発行済数量	45,647,410,248口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4327円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	132,962,814,489円
負債総額	20,264,517,873円
純資産総額(-)	112,698,296,616円
発行済数量	56,907,959,579口
1口当たり純資産額(/)	1.9804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(2022年6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(2022年6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。

2022年6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	1,478,276,781,447
追加型株式投資信託	809	14,302,967,516,746
単位型公社債投資信託	26	50,827,152,396
単位型株式投資信託	221	1,095,208,940,961
合計	1,082	16,927,280,391,550

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 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期事業年度の財務諸表及び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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第37期事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	36,734	31,421
金銭の信託	25,670	30,332
未収委託者報酬	16,804	17,567
未収運用受託報酬	5,814	4,348
未収投資助言報酬	317	309
未収収益	7	5
前払費用	724	1,167
その他	2,419	2,673
流動資産計	88,493	87,826
固定資産		
有形固定資産	1,119	1,268
建物	1 915	1 1,109
器具備品	1 202	1 158
建設仮勘定	0	-
無形固定資産	3,991	4,561
ソフトウェア	2,878	3,107
ソフトウェア仮勘定	1,109	1,449
電話加入権	3	3
投資その他の資産	11,153	10,153
投資有価証券	261	241
関係会社株式	5,299	5,349
長期差入保証金	1,324	1,102
繰延税金資産	3,676	3,092
その他	591	367
固定資産計	16,264	15,983
資産合計	104,757	103,810

(単位:百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,730	1,445
未払金	7,337	7,616
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	9
未払手数料	6,889	7,430
その他未払金	437	175
未払費用	9,713	8,501
未払法人税等	4,199	2,683
未払消費税等	2,106	1,330
賞与引当金	1,789	1,933
役員賞与引当金	76	69
流動負債計	28,954	23,581
固定負債		
退職給付引当金	2,292	2,507
時効後支払損引当金	157	147
固定負債計	2,450	2,655
負債合計	31,404	26,236
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	51,800	56,020
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	51,676	55,896
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	19,996	24,216
株主資本計	73,353	77,573
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	73,353	77,573
負債・純資産合計	104,757	103,810

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	89,905		108,563	
運用受託報酬	17,640		16,716	
投資助言報酬	1,103		1,587	
その他営業収益	781		12	
営業収益計		109,430		126,879
営業費用				
支払手数料	37,003		45,172	
広告宣伝費	424		391	
公告費	0		0	
調査費	30,794		36,488	
調査費	11,302		10,963	
委託調査費	19,491		25,525	
委託計算費	543		557	
営業雑経費	938		842	
通信費	46		35	
印刷費	680		606	
協会費	71		66	
諸会費	23		26	
支払販売手数料	116		106	
営業費用計		69,704		83,453
一般管理費				
給料	10,586		10,377	
役員報酬	163		168	
給料・手当	9,030		8,995	
賞与	1,392		1,213	
交際費	8		6	
寄付金	7		15	
旅費交通費	50		40	
租税公課	912		367	
不動産賃借料	1,499		1,674	
退職給付費用	524		495	
固定資産減価償却費	1,078		1,389	
福利厚生費	44		42	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	1,789		1,933	
役員賞与引当金繰入額	76		69	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,793		3,901	
事務用消耗品費	68		45	
器具備品費	0		0	
諸経費	152		217	
一般管理費計		20,594		20,578
営業利益		19,132		22,848

（単位：百万円）

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）		第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	27		13	
受取配当金	2		1	559
時効成立分配金・償還金	0		0	
為替差益	7		7	
金銭の信託運用益	1,229		-	
雑収入	13		19	
時効後支払損引当金戻入額	13		10	
営業外収益計		1,293		610
営業外費用				
投資信託償還損	0		-	
金銭の信託運用損	-		743	
早期割増退職金	48		20	
雑損失	0		-	
営業外費用計		48		764
経常利益		20,376		22,694
特別利益				
固定資産売却益	-		0	
特別利益計		-		0
特別損失				
固定資産除却損	1		5	
投資有価証券売却損	-		6	
ゴルフ会員権売却損	-		3	
オフィス再編費用	-		2	509
特別損失計		1		525
税引前当期純利益		20,375		22,169
法人税、住民税及び事業税		7,418		6,085
法人税等調整額		1,168		584
法人税等合計		6,249		6,669
当期純利益		14,125		15,499

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,871	49,674	71,227
当期変動額									
剰余金の配当							12,000	12,000	12,000
当期純利益							14,125	14,125	14,125
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	2,125	2,125
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	0	0	73,353

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							11,280	11,280	11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	4,219
当期末残高	0	0	77,573

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 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 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

(会計上の見積りの変更)

第37期

(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

当社は、当事業年度において、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、当事業年度において、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万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。

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。

(未適用の会計基準等)

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(会計基準適用指針第31号 2021年6月17日)

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分法相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業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

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
建物	407	415
器具備品	978	966

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第37期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
受取配当金	-	543

2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第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 (百万円)	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	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

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

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2022年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期(2021年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	25,670	25,670	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,672	25,672	-

第37期(2022年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	30,332	30,332	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	30,334	30,334	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	36,734	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	85,024	1	-	-

第37期(2022年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	-	-	-
(2) 金銭の信託	30,332	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	17,567	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,348	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	83,670	1	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	6,932	-	6,932
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	6,932	-	6,932

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

（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、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	259	239
関係会社株式		
非上場株式	5,299	5,349

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(第36期の貸借対照表計上額5,299百万円、第37期の貸借対照表計上額5,349百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第36期(2021年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
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	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額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。

第37期(2022年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
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	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額239百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
投資信託	0	-	0

（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。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	-	6

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	4	14
退職給付の支払額	245	185
過去勤務費用の発生額	1	-
その他	1	-
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,479	2,576
未積立退職給付債務	2,479	2,576
未認識数理計算上の差異	84	35
未認識過去勤務費用	102	33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507
退職給付引当金	2,292	2,507
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	41	34
過去勤務費用の費用処理額	69	69
その他	7	3
確定給付制度に係る退職給付費用	409	398

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において48百万円、当事業年度において20百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.76%	1.00% ~ 3.76%

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100百万円、当事業年度97百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第36期	第37期
	(2021年3月31日現在)	(2022年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	260	156
未払事業所税	10	10
賞与引当金	547	592
未払法定福利費	92	92
運用受託報酬	1,410	845
資産除去債務	18	13
減価償却超過額(一括償却資産)	25	12
減価償却超過額	51	58
繰延資産償却超過額(税法上)	301	292
退職給付引当金	701	767
時効後支払損引当金	48	45
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	166
投資有価証券評価損	28	28
その他	3	2
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産小計	3,676	3,092
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	3,676	3,092
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	3,676	3,092

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	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224百万円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451百万円
	うち現金・預金	11,605百万円
	うち金銭の信託	11,792百万円
b. 負債の額	負債合計	9,256百万円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030百万円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030百万円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	84,609百万円	76,763百万円
資産合計	84,609百万円	76,763百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	5,570百万円	4,740百万円
負債合計	5,570百万円	4,740百万円
純資産	79,038百万円	72,022百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	59,074百万円	55,263百万円
顧客関連資産	29,793百万円	25,175百万円

(2) 損益計算書項目

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,823百万円	8,429百万円
経常利益	8,823百万円	8,429百万円
税引前当期純利益	8,823百万円	8,429百万円
当期純利益	7,288百万円	7,015百万円
1株当たり当期純利益	182,220円85銭	175,380円68銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円
運用受託報酬	14,425百万円
投資助言報酬	1,587百万円
成功報酬（注）	2,594百万円
その他営業収益	12百万円
合計	126,879百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬及び運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）及び第37期（自 2021年4月1日 至 2022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36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

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。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435	未払 手数料	1,457
	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	未払 手数料	2,524

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	7,789	未払 手数料	1,592
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	16,373	未払 手数料	2,651

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36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36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
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2022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（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2022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 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
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、「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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年8月12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12月14日から2022年6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2022年6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。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年8月12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12月14日から2022年6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2022年6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。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。