



DIAM DC 8資産バランスファンド

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

愛称: 宝船

追加型投信/内外/資産複合(インデックス型)

■この目論見書により行う「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2023年10月11日に関東財務局長に提出しており、2023年10月12日にその効力が生じております。

■「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

アセットマネジメントOne株式会社

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
ファンドは、課税上「株式投資信託」として取り扱われます。

■委託会社への照会先

【コールセンター】 **0120-104-694** (受付時間: 営業日の午前9時~午後5時)

【ホームページアドレス】 <https://www.am-one.co.jp/>

発行者名	アセットマネジメントOne株式会社
代表者の役職氏名	取締役社長 杉原 規之
本店の所在の場所	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当事項はありません。

目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
第2【管理及び運営】	88
第3【ファンドの経理状況】	95
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	413
第三部【委託会社等の情報】	415
第1【委託会社等の概況】	415
約款	444

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

（以上を総称して、「D I A M D C 8資産バランスファンド」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、愛称として「宝船」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。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1口以上1口単位または1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2023年10月12日から2024年4月11日まで

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

※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

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積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は、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。

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

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、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

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

○振替受益権について

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

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

(参考)

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ①各ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。
- ②各ファンドの信託金の限度額は各々、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 主としてマザーファンド^{※1}への投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券^{※2}に投資します。

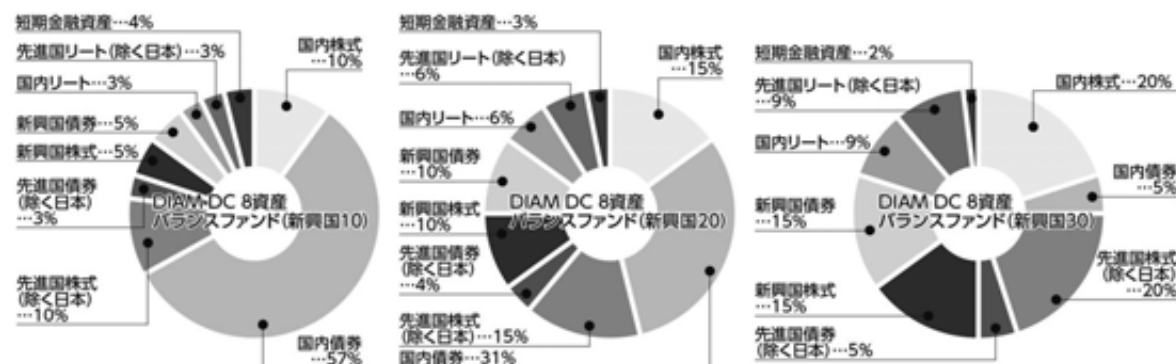
※1 各ファンドが投資するマザーファンドは下記のとおりです。(以下を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

マザーファンド
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
外国債券パッシブ・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
J-REITインデックスファンド・マザーファンド
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※2 「不動産投資信託証券」(以下「リート(REIT)」という場合があります。)とは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資者から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入等が投資者に分配される商品を行います。

2 次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。

<基本アロケーション>



※マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下のとおりです。

資産	ベンチマーク
国内株式	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
国内債券	NOMURA-BPI総合
先進国株式(除く日本)	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)
先進国債券(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
新興国債券	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)
国内リート	東証REIT指数(配当込み)
先進国リート(除く日本)	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)
短期金融資産	コール・ローン(オーバーナイト物)

※合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークの騰落率を基本アロケーションに乗じて指数化したものです。

3 実質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。

■ 分配方針

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

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

○商品分類表

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

○属性区分表

- DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）
- DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）
- DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファ ンド	あり ()	日経225 TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	その他 (合成ベンチマー ク)
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

※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

<p>その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券、不動産投信) 資産配分固定型))</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産(株式、債券、不動産投信)を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。</p> <p>(注) 商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分固定型))に分類されます。</p>
<p>年1回</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>グローバル (日本を含む)</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>ファミリーファンド</p>	<p>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。</p>
<p>為替ヘッジなし</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。</p>
<p>その他</p>	<p>日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。</p>

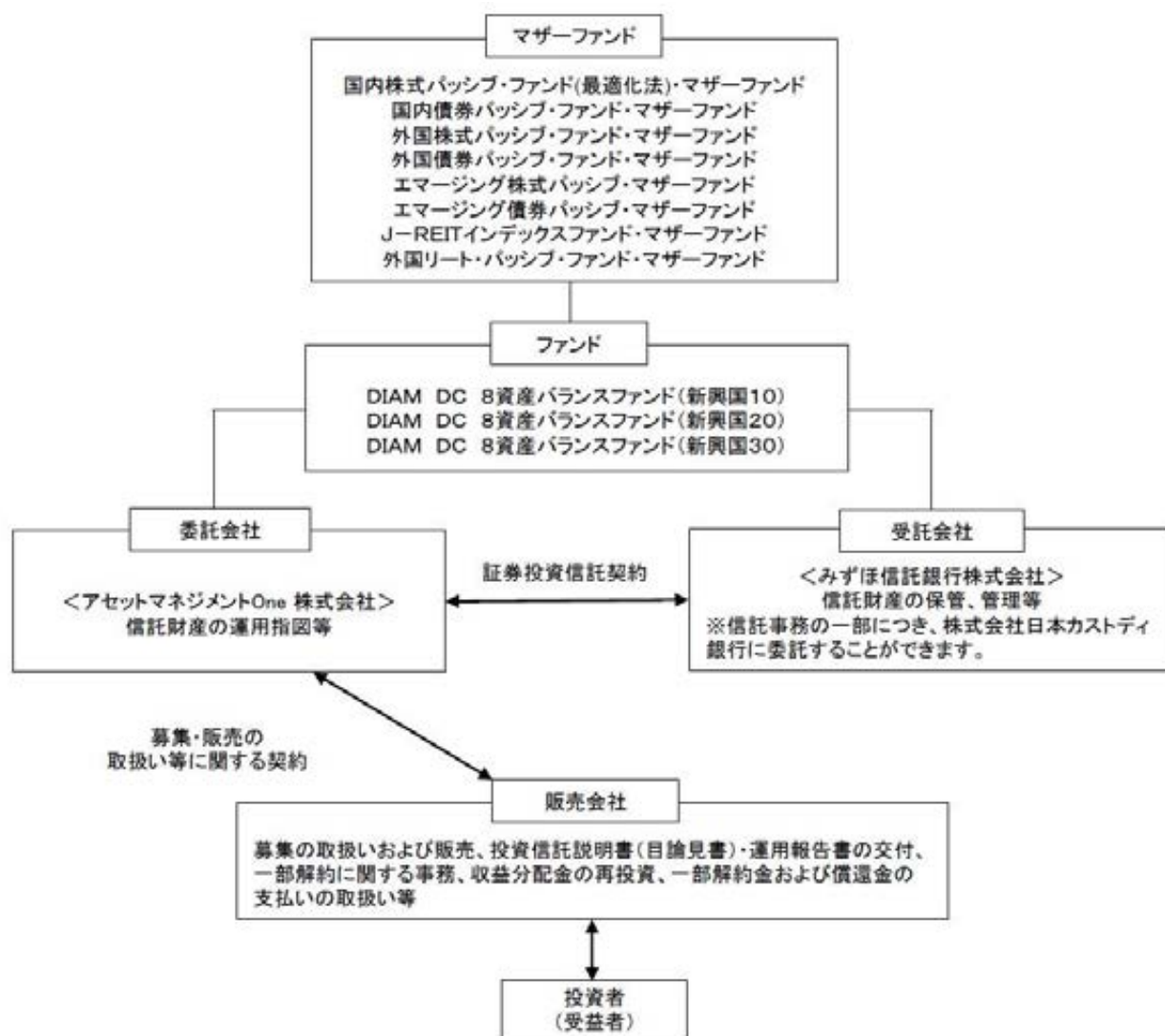
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2012年9月6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、ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

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

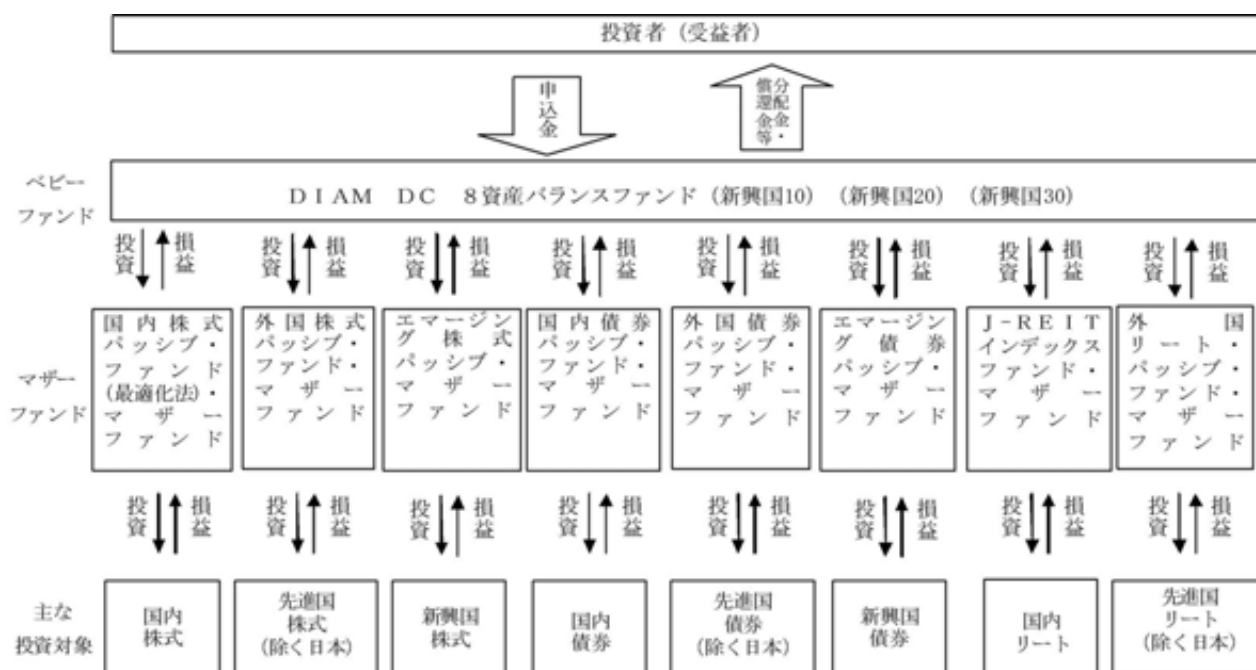
- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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、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。

● 「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の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（2023年7月31日現在）

委託会社の沿革

- | | |
|------------|---|
| 1985年7月1日 | 会社設立 |
| 1998年3月31日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得 |
| 1998年12月1日 | 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可 |
| 1999年10月1日 | 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。 |
| 2008年1月1日 | 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「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

(2023年7月31日現在)

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

<投資対象>

主として、以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

1. 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
2. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. エマージング株式パッシブ・マザーファンド
6. エマージング債券パッシブ・マザーファンド
7. J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
8. 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

<投資態度>

- ① 主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。

- ② 次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。

<基本アロケーション>

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

国内株式	10%
国内債券	57%
先進国株式（除く日本）	10%
先進国債券（除く日本）	3%
新興国株式	5%
新興国債券	5%
国内不動産投資信託証券	3%
先進国不動産投資信託証券（除く日本）	3%
短期金融資産	4%

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

国内株式	15%
国内債券	31%
先進国株式（除く日本）	15%
先進国債券（除く日本）	4%
新興国株式	10%
新興国債券	10%
国内不動産投資信託証券	6%
先進国不動産投資信託証券（除く日本）	6%
短期金融資産	3%

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

国内株式	20%
国内債券	5%
先進国株式（除く日本）	20%
先進国債券（除く日本）	5%
新興国株式	15%
新興国債券	15%
国内不動産投資信託証券	9%
先進国不動産投資信託証券（除く日本）	9%
短期金融資産	2%

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下のとおりです。

国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
国内債券	NOMURA-BPI総合
先進国株式 (除く日本)	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)
先進国債券 (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
新興国債券	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)
国内不動産 投資信託証券	東証REIT指数(配当込み)
先進国不動産 投資信託証券 (除く日本)	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)
短期金融資産	コール・ローン(オーバーナイト物)

- ③ マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。
- ④ 実質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。
- ⑤ 上記にかかわらず、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、および純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

■対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成ベンチマークに連動させるため、以下の対応を行います。

各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションとの乖離について乖離許容範囲を定めその範囲内に維持するよう運用を行うことにより、合成ベンチマークに概ね連動させます。なお、乖離距離範囲を超えた場合にはリバランスを実施いたします。

なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針 (2)投資対象 (参考)各ファンドが投資するマザーファンドの概要をご参照ください。

(2) 【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、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。）および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.～12.の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、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。また、「不動産投資信託証券」とは、「投資信託証券」のうち一般社団法人投資信託協会規則に定めるものをいいます。

③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②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

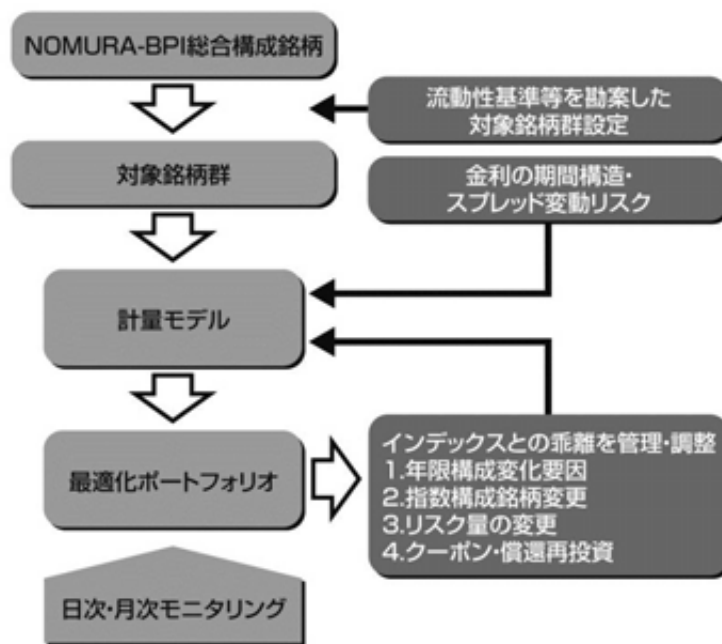
(参考) 各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）※」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <p>※①東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>②JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（TOPIX）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>③JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>④JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p> <p>⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</p> <p>⑧以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</p>

<p>運用プロセス</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。 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、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
<p>主な投資制限</p>	<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. 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。 3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 4. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
--------------	------------------------------

基本方針	この投資信託は、NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI 総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>※NOMURA-BPI 総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>
運用プロセス	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA-BPI 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因</p> <p>2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資



<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
---------------	--

<p>ファンド名</p>	<p>外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>

	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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>※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。</p> <p>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</p>

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

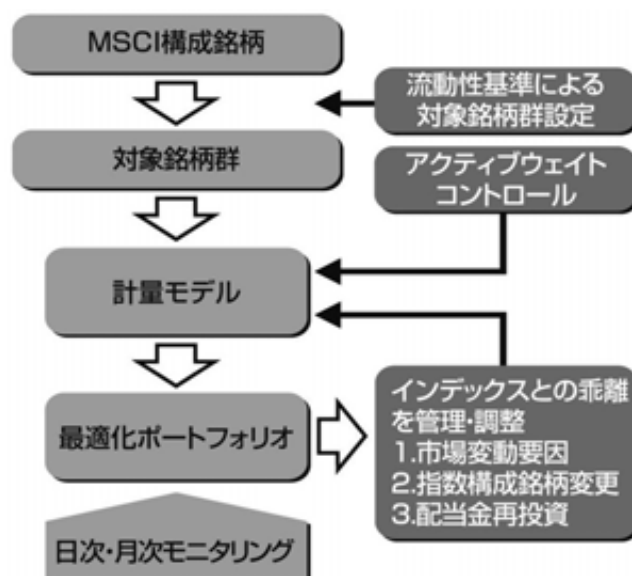
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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



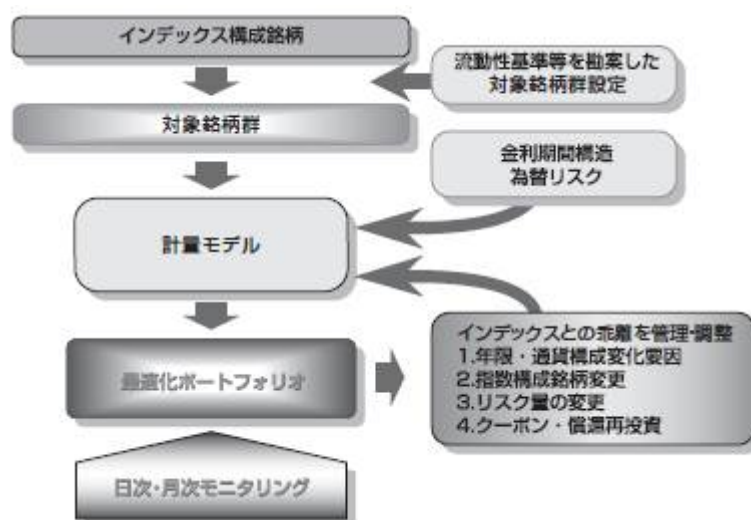
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、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。
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 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。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 <p>※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p>

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。

運用プロセス

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



主な投資制限

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。
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. 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。
3. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
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、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>（*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、株式の組入比率は高位を維持します。 3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 <p>※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</p>

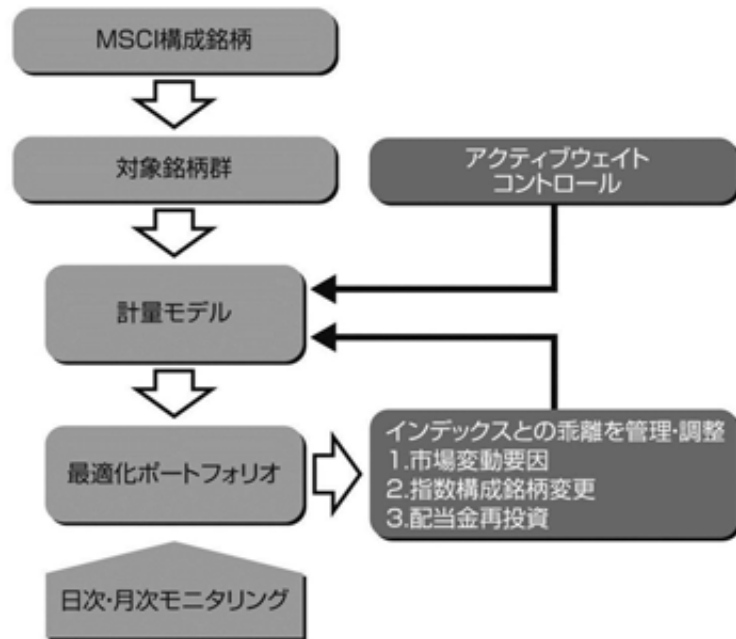
価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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>主な投資制限</p>	<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。
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>エマージング債券パッシブ・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>新興国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボ

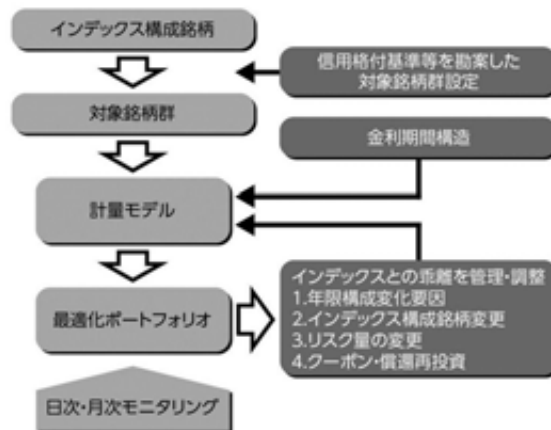
ンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。
3. 組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。
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。

※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。

運用プロセス

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。

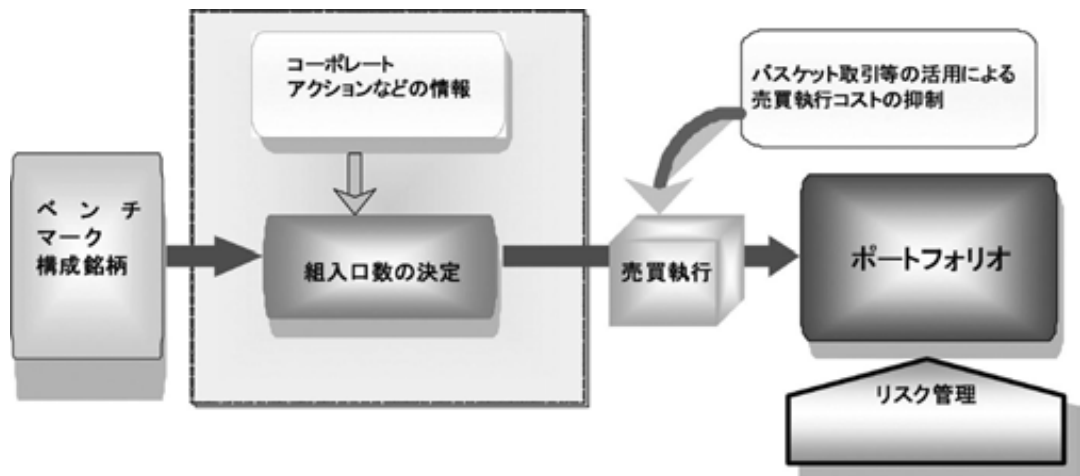


主な投資制限

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	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
	<p>※①東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>②JPXは、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>③JPXは、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>④JPXは、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p> <p>⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</p> <p>⑧以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</p>
運用プロセス	<p>1. 原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</p> <p>2. 新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</p>

3. 配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。



<p>主な投資制限</p>	<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. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 3. 株式への投資は行いません。 4. 外貨建資産への投資は行いません。 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。 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。
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>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。</p>
<p>投資態度</p>	<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。

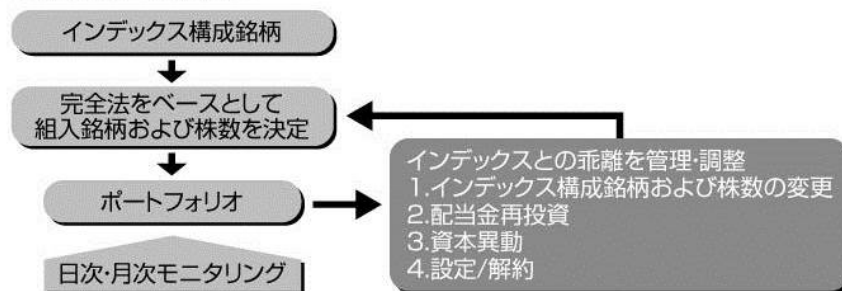
※S & P 先進国 REITインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 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 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

運用プロセス

ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。



主な投資制限

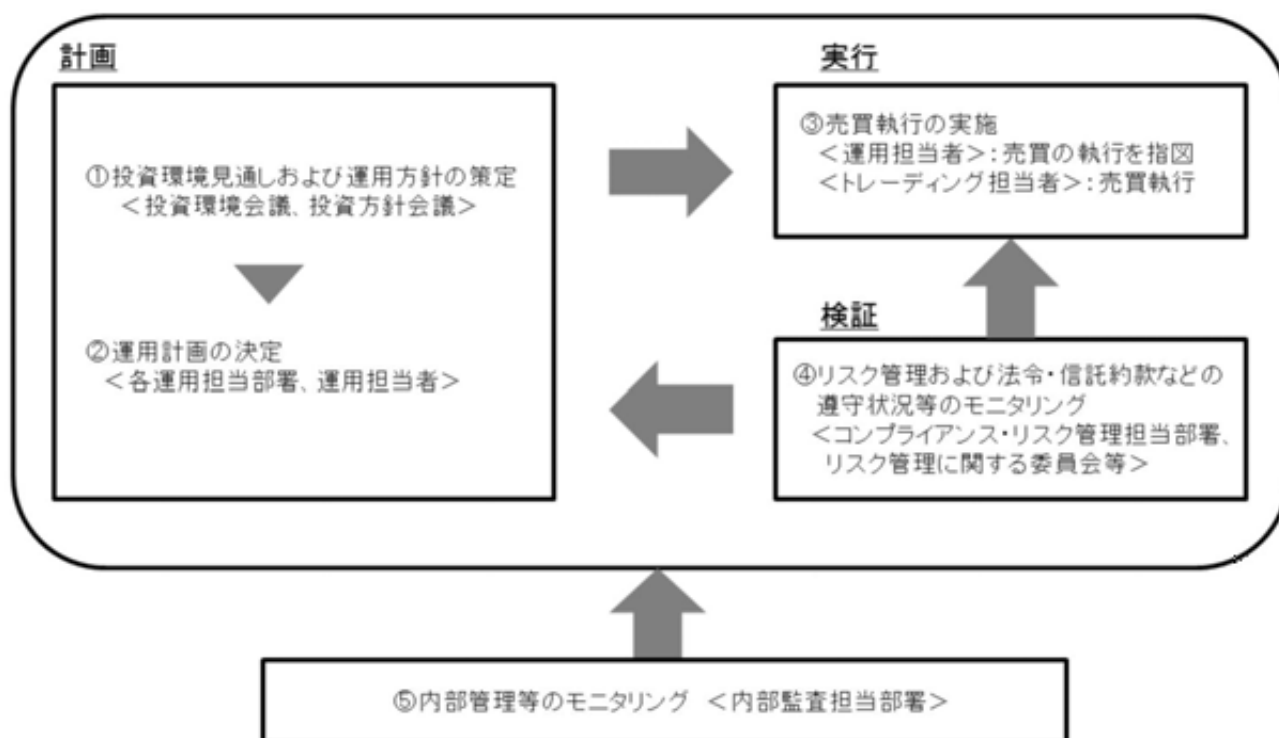
1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
3. 株式への直接投資は行いません。
4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2023年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時に、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。

②収益の分配方式

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

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

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

(2) 上記1)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。

③収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に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けを行います。当該売付け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】

①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）

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

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

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する実質比率は、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つ

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）

⑤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（上場予定を含みます。）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、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。

⑥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ます。）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

⑦先物取引等の運用指図（約款第22条）

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

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

(3) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引な

らびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

⑧スワップ取引の運用指図（約款第23条）

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

⑨金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

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

⑩デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

⑪有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

- (1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.～2.の範囲内で貸付け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.の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、有価証券の貸付け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。

⑫特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26条）

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

⑬外国為替予約取引の指図（約款第27条）

- (1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。
- (2) 上記(1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (3) 上記(2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その越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。

⑭資金の借入れ（約款第33条）

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

⑮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や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

各ファンドが実質的に投資する各資産の配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。この資産配分が各ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、各ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。各ファンドは、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。

金利リスクとは、金利の変動を受けて債券・リートの価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券・リートの価格は下落します。各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。

各ファンドは、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

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。各ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジ

ジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

・信用リスク

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

各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、各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。

各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。

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合、または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する場合があります。また、実質的に投資を行う新興国の通貨や有価証券等の発行者が属する国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化などが為替市場や株式、債券市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制などの種々な規制の導入や政策の変更等の要因も為替市場や株式、債券市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

○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、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、各マザーファンドへの投資を通じて合成ベンチマークに概ね連動する投資成果をめざして運用を行いますが、各マザーファンドが各対象ベンチマーク採用全銘柄を組入れないこと、資金流出入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成ベンチマークが乖離する場合があります。

○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。

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

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

○各ファンドは、受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象ベンチマークが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、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。

○各ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

○注意事項

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

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

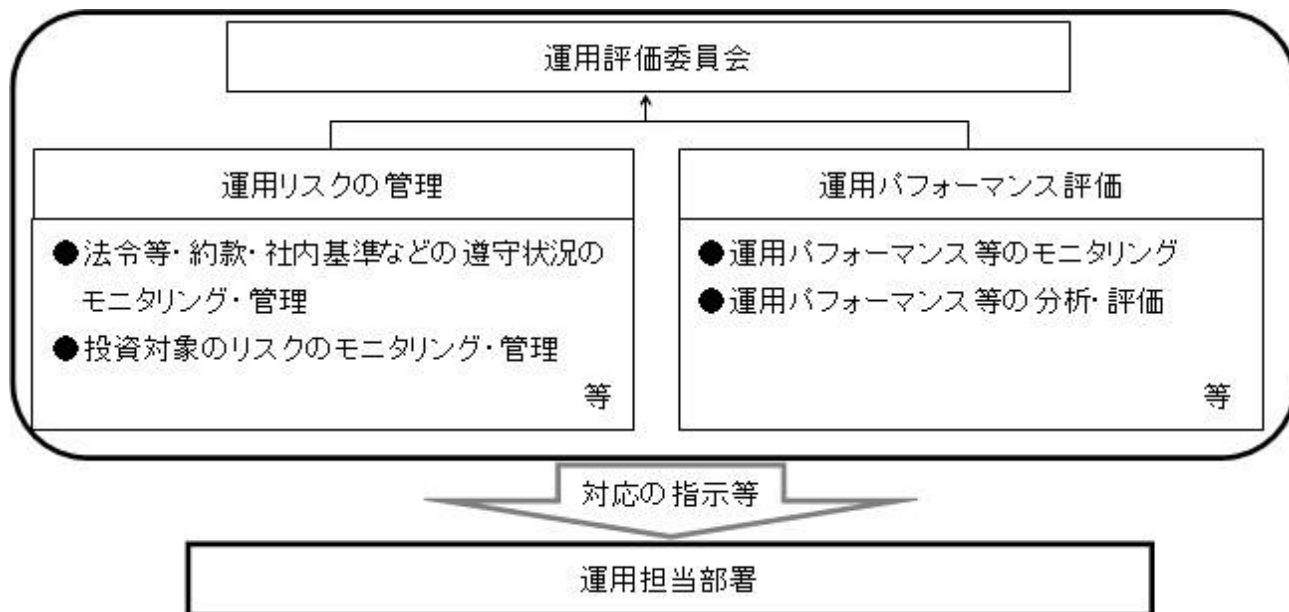
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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

<リスク管理体制>

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

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



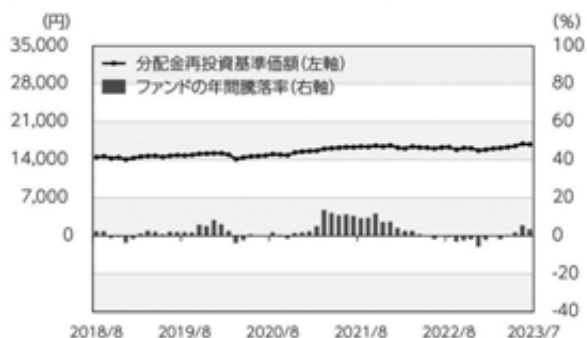
- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は2023年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

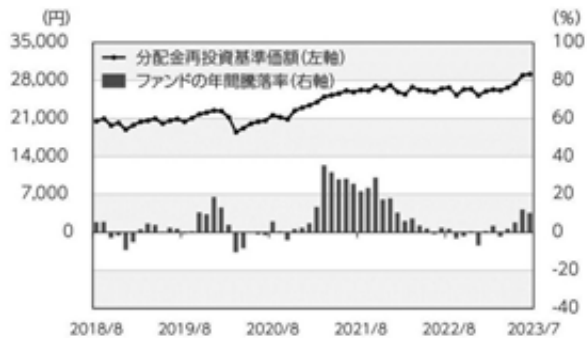
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)



DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

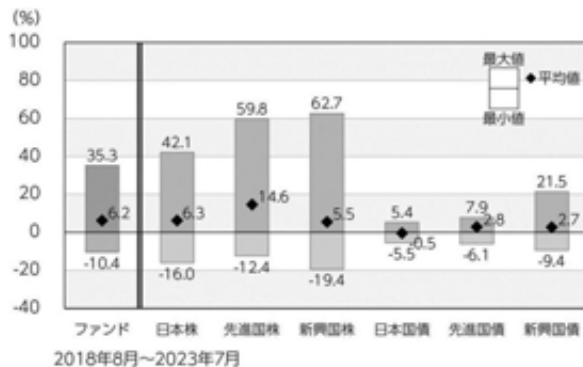
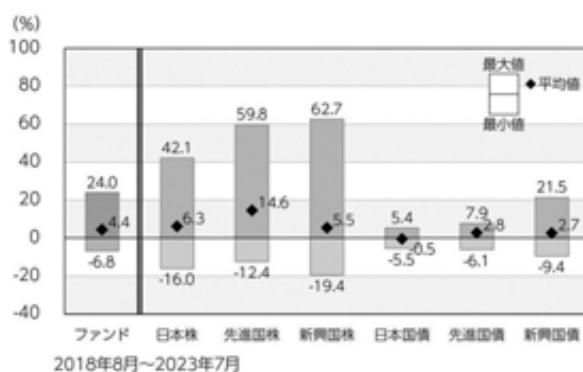
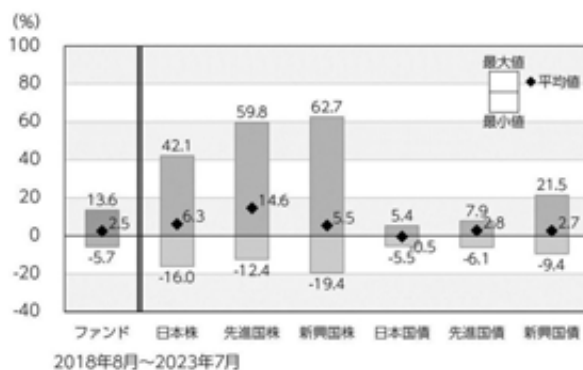


DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)



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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの信託報酬およびその配分は、日々の純資産総額に対して以下の通りとします。

ファンド名	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
信託報酬 税込（税抜）			
D I A M D C 8 資産バランス ファンド（新興国10） 年率0.3465%（税抜0.315%）	0.155%	0.125%	0.035%
D I A M D C 8 資産バランス ファンド（新興国20） 年率0.3795%（税抜0.345%）	0.170%	0.140%	0.035%
D I A M D C 8 資産バランス ファンド（新興国30） 年率0.4125%（税抜0.375%）	0.185%	0.155%	0.035%
主な役務	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	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	運用財産の保管・管 理、委託会社からの 運用指図の実行等の 対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

◆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。

- ①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。
- ②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。
- ③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。
- ④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。

※上場不動産投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託（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

①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。

②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。

③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。

○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。

※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

※上記は、2023年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

<個別元本について>

- ①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。
- ②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ついて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個別元本の算出が行われる場合があります。
- ③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、①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、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る

部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

… (参考情報) ファンドの総経費率 …

ファンド名	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	0.37%	0.35%	0.03%
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	0.43%	0.38%	0.05%
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	0.48%	0.41%	0.07%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年1月12日~2023年1月11日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	10,952,797,994	95.98
内 日本	10,952,797,994	95.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	458,275,231	4.02
純資産総額	11,411,073,225	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。

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	8,661,074,768	96.99
内 日本	8,661,074,768	96.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	268,528,353	3.01
純資産総額	8,929,603,121	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。

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	10,909,279,787	98.01
内 日本	10,909,279,787	98.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	221,795,350	1.99
純資産総額	11,131,075,137	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	434,377,507,230	97.52
内 日本	434,377,507,230	97.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,049,432,683	2.48
純資産総額	445,426,939,913	100.00

その他資産の投資状況

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）	11,053,250,000	2.48
内 日本	11,053,250,000	2.48

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	375,001,260,000	80.57
内 日本	375,001,260,000	80.57
地方債証券	31,322,749,758	6.73
内 日本	31,322,749,758	6.73
特殊債券	29,700,643,162	6.38
内 日本	29,700,643,162	6.38
社債券	25,367,914,980	5.45
内 日本	24,773,135,980	5.32
内 フランス	594,779,000	0.13
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	4,038,960,965	0.87
純資産総額	465,431,528,865	100.00

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	1,063,006,420,772	96.30
内 アメリカ	755,575,919,164	68.45
内 イギリス	44,407,373,886	4.02
内 カナダ	37,317,785,117	3.38
内 フランス	35,536,913,006	3.22
内 スイス	35,325,332,137	3.20
内 ドイツ	27,080,040,803	2.45
内 オランダ	21,703,039,887	1.97
内 オーストラリア	21,397,281,038	1.94
内 アイルランド	19,940,419,983	1.81
内 スウェーデン	9,380,064,568	0.85
内 デンマーク	9,255,487,087	0.84
内 スペイン	8,015,367,519	0.73
内 香港	5,948,305,546	0.54
内 イタリア	5,915,846,631	0.54
内 ジャージー	3,829,533,015	0.35
内 シンガポール	3,560,867,698	0.32
内 フィンランド	3,416,477,957	0.31
内 ベルギー	2,433,310,554	0.22
内 イスラエル	2,059,605,937	0.19
内 ノルウェー	2,052,773,998	0.19
内 ケイマン諸島	1,937,748,431	0.18
内 バミューダ	1,696,803,514	0.15
内 オランダ領キュラソー	1,622,678,899	0.15
内 ニュージーランド	832,632,792	0.08
内 ポルトガル	572,763,838	0.05
内 ルクセンブルグ	561,075,905	0.05
内 オーストリア	558,335,029	0.05
内 リベリア	487,207,658	0.04

	内 パナマ	344,821,161	0.03
	内 マン島	240,608,014	0.02
投資信託受益証券		1,744,727,108	0.16
	内 オーストラリア	1,281,818,211	0.12
	内 シンガポール	462,908,897	0.04
投資証券		20,353,382,371	1.84
	内 アメリカ	19,088,798,647	1.73
	内 イギリス	447,051,663	0.04
	内 フランス	375,861,181	0.03
	内 香港	278,678,893	0.03
	内 ベルギー	85,064,732	0.01
	内 カナダ	77,927,255	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		18,766,718,662	1.70
純資産総額		1,103,871,248,913	100.00

その他資産の投資状況

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	19,286,630,167	1.75
内 アメリカ	14,513,605,116	1.31
内 ドイツ	2,883,971,772	0.26
内 イギリス	835,458,840	0.08
内 カナダ	656,117,800	0.06
内 オーストラリア	397,476,639	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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	227,434,478,182	98.72
内 アメリカ	110,460,072,593	47.95
内 フランス	19,002,203,404	8.25
内 イタリア	17,635,345,883	7.65
内 ドイツ	15,104,016,989	6.56
内 中国	12,901,594,716	5.60
内 スペイン	11,503,844,976	4.99
内 イギリス	11,283,525,836	4.90
内 カナダ	4,585,612,114	1.99
内 ベルギー	4,201,957,918	1.82
内 オランダ	3,594,898,940	1.56
内 オーストラリア	3,401,116,199	1.48
内 オーストリア	2,860,380,455	1.24
内 メキシコ	2,283,127,436	0.99
内 アイルランド	1,370,927,404	0.60
内 フィンランド	1,217,321,460	0.53
内 マレーシア	1,174,356,211	0.51
内 ポーランド	1,174,179,746	0.51

内 シンガポール	1,013,419,931	0.44
内 デンマーク	711,887,115	0.31
内 イスラエル	649,579,786	0.28
内 ニュージーランド	482,027,137	0.21
内 スウェーデン	460,689,084	0.20
内 ノルウェー	362,392,849	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,950,415,362	1.28
純資産総額	230,384,893,544	100.00

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	109,437,216,955	94.10
内 ケイマン諸島	19,561,415,860	16.82
内 台湾	16,165,055,659	13.90
内 インド	15,780,658,662	13.57
内 韓国	13,679,459,552	11.76
内 中国	12,465,885,861	10.72
内 ブラジル	5,770,894,000	4.96
内 サウジアラビア	4,580,334,668	3.94
内 南アフリカ	3,670,621,094	3.16
内 メキシコ	2,376,391,678	2.04
内 タイ	2,146,121,904	1.85
内 インドネシア	2,127,914,279	1.83
内 マレーシア	1,496,150,700	1.29
内 アラブ首長国連邦	1,417,270,816	1.22
内 香港	1,126,191,257	0.97
内 カタール	1,010,137,902	0.87
内 クエート	899,305,656	0.77
内 ポーランド	863,601,077	0.74
内 フィリピン	700,948,034	0.60
内 トルコ	676,590,462	0.58
内 チリ	605,888,524	0.52
内 アメリカ	509,468,052	0.44
内 バミューダ	492,537,856	0.42
内 ギリシャ	486,711,562	0.42
内 ハンガリー	254,207,778	0.22
内 チェコ	161,431,353	0.14
内 ルクセンブルグ	120,975,925	0.10
内 コロンビア	110,975,520	0.10
内 オランダ	63,585,788	0.05
内 エジプト	62,878,524	0.05
内 シンガポール	27,692,051	0.02
内 ペルー	25,914,901	0.02
内 ロシア	0	0.00
内 キプロス	0	0.00
内 イギリス領バージン諸島	0	0.00
投資信託受益証券	889,663,678	0.76

	内 メキシコ	635,187,588	0.55
	内 ブラジル	254,476,090	0.22
投資証券		109,608,324	0.09
	内 メキシコ	64,808,225	0.06
	内 南アフリカ	44,800,099	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,866,883,607	5.04
純資産総額		116,303,372,564	100.00

その他資産の投資状況

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,870,117,673	5.05
内 アメリカ	5,870,117,673	5.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	122,685,214,143	97.48
内 サウジアラビア	13,364,527,431	10.62
内 メキシコ	12,460,145,488	9.90
内 アラブ首長国連邦	9,711,383,402	7.72
内 カタール	9,311,533,700	7.40
内 チリ	8,374,715,500	6.65
内 コロンビア	8,139,396,508	6.47
内 ブラジル	8,058,351,318	6.40
内 ドミニカ共和国	7,763,143,408	6.17
内 ハンガリー	7,622,132,589	6.06
内 パナマ	6,302,853,634	5.01
内 インドネシア	6,280,597,924	4.99
内 南アフリカ	6,037,939,073	4.80
内 ルーマニア	4,475,917,887	3.56
内 ペルー	4,373,320,647	3.47
内 フィリピン	3,898,337,996	3.10
内 オマーン	3,842,846,992	3.05
内 ウルグアイ	1,794,370,521	1.43
内 中国	873,700,125	0.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,167,824,342	2.52
純資産総額	125,853,038,485	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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	195,199,144,500	97.74
内 日本	195,199,144,500	97.74

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,519,792,245	2.26
純資産総額	199,718,936,745	100.00

その他資産の投資状況

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	4,357,336,500	2.18
内 日本	4,357,336,500	2.18

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31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	8,734,544,985	10.30
内 オーストラリア	5,554,556,562	6.55
内 シンガポール	3,111,407,367	3.67
内 香港	68,581,056	0.08
投資証券	75,790,247,170	89.41
内 アメリカ	65,717,755,191	77.53
内 イギリス	3,861,927,527	4.56
内 フランス	1,469,919,224	1.73
内 カナダ	1,413,417,804	1.67
内 香港	1,054,812,550	1.24
内 ベルギー	885,725,327	1.04
内 スペイン	347,829,802	0.41
内 ニュージーランド	341,831,192	0.40
内 韓国	187,815,601	0.22
内 オランダ	167,025,130	0.20
内 ガーンジー	166,499,155	0.20
内 イスラエル	101,632,321	0.12
内 ドイツ	36,132,386	0.04
内 アイルランド	29,861,083	0.04
内 イタリア	8,062,877	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	239,852,374	0.28
純資産総額	84,764,644,529	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】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資 信託受	4,990,651,982	1.2370	1.2505	—	54.69

	日本	益証券		6,173,613,970	6,240,810,303	—	
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	167,584,537	5.9042 989,455,785	7.2676 1,217,937,381	— —	10.67
3	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	303,367,667	3.2443 984,244,901	4.0083 1,215,988,619	— —	10.66
4	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	401,972,605	1.4028 563,911,626	1.5690 630,695,017	— —	5.53
5	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	271,810,079	1.9492 529,830,094	2.1475 583,712,144	— —	5.12
6	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	214,120,117	1.5726 336,727,400	1.7623 377,343,882	— —	3.31
7	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	159,329,380	2.0095 320,179,792	2.1569 343,657,539	— —	3.01
8	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	143,513,616	2.3009 330,212,601	2.3876 342,653,109	— —	3.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	95.98
合計	95.98

(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。

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,171,980,918	1.2378 2,688,478,498	1.2505 2,716,062,137	— —	30.42
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	189,362,242	5.9027 1,117,752,315	7.2676 1,376,209,029	— —	15.41
3	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	340,413,028	3.2353 1,101,349,136	4.0083 1,364,477,540	— —	15.28
4	エマージング株式パッシ	親投資	594,488,036	1.4062	1.5690	—	10.45

	ブ・マザーファンド 日本	信託受益証券		835,989,988	932,751,728	—	
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	404,050,500	1.9503 788,036,253	2.1475 867,698,448	—	9.72
6	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	311,129,613	1.5777 490,878,497	1.7623 548,303,716	—	6.14
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	218,451,664	2.3102 504,688,852	2.3876 521,575,192	—	5.84
8	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	154,850,470	2.0095 311,186,180	2.1569 333,996,978	—	3.74

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	96.99
合計	96.99

(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。

D I A M D C 8 資産バランスファンド (新興国30)

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	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	309,588,404	5.9063 1,828,536,967	7.2676 2,249,964,684	—	20.21
2	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	560,449,140	3.2474 1,820,005,901	4.0083 2,246,448,287	—	20.18
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	1,082,037,334	1.4070 1,522,432,170	1.5690 1,697,716,577	—	15.25
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	768,153,198	1.9576 1,503,770,669	2.1475 1,649,608,992	—	14.82
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	417,058,355	2.3111 963,891,156	2.3876 995,768,528	—	8.95
6	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	564,968,324	1.5792 892,241,400	1.7623 995,643,677	—	8.94
7	外国債券パッシブ・ファン	親投資	249,879,535	2.0168	2.1569	—	4.84

	ド・マザーファンド 日本	信託受 益証券		503,977,549	538,965,169	—	
8	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	427,959,915	1.2384 529,985,945	1.2505 535,163,873	— —	4.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.01
合計	98.01

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	7,222,400	1,896.32 13,695,991,310	2,386.00 17,232,646,400	— —	3.87
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	930,400	12,038.97 11,201,060,660	13,315.00 12,388,276,000	— —	2.78
3	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	8,113,000	933.17 7,570,847,895	1,146.00 9,297,498,000	— —	2.09
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	131,600	61,162.40 8,048,972,935	63,760.00 8,390,816,000	— —	1.88
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	42,258,400	154.78 6,540,902,793	162.90 6,883,893,360	— —	1.55
6	三菱商事 日本	株式 卸売業	848,500	4,625.78 3,924,975,200	7,265.00 6,164,352,500	— —	1.38
7	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	920,700	5,622.33 5,176,482,141	6,694.00 6,163,165,800	— —	1.38
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	646,000	7,057.14 4,558,915,453	9,298.00 6,006,508,000	— —	1.35
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	278,400	15,624.81 4,349,947,981	21,245.00 5,914,608,000	— —	1.33
10	三井物産 日本	株式 卸売業	987,600	3,933.85 3,885,074,565	5,541.00 5,472,291,600	— —	1.23
11	任天堂 日本	株式 その他製 品	830,400	5,598.37 4,648,893,560	6,450.00 5,356,080,000	— —	1.20
12	信越化学工業	株式	1,095,200	3,874.40	4,679.00	—	1.15

	日本	化学		4,243,251,807	5,124,440,800	—	
13	武田薬品工業	株式 医薬品	1,167,500	4,197.71 4,900,832,073	4,341.00 5,068,117,500	— —	1.14
14	第一三共	株式 医薬品	1,149,200	4,128.00 4,743,905,686	4,347.00 4,995,572,400	— —	1.12
15	リクルートホールディングス	株式 サービス業	1,001,000	4,273.35 4,277,626,981	4,933.00 4,937,933,000	— —	1.11
16	伊藤忠商事	株式 卸売業	857,500	4,084.33 3,502,316,239	5,750.00 4,930,625,000	— —	1.11
17	本田技研工業	株式 輸送用機器	1,069,200	3,299.16 3,527,463,119	4,513.00 4,825,299,600	— —	1.08
18	ソフトバンクグループ	株式 情報・通信業	650,700	6,165.49 4,011,887,771	7,242.00 4,712,369,400	— —	1.06
19	HOYA	株式 精密機器	278,700	14,248.46 3,971,046,437	16,530.00 4,606,911,000	— —	1.03
20	ダイキン工業	株式 機械	158,600	23,012.64 3,649,805,550	28,690.00 4,550,234,000	— —	1.02
21	みずほフィナンシャルグループ	株式 銀行業	1,873,500	2,068.05 3,874,501,363	2,404.00 4,503,894,000	— —	1.01
22	KDDI	株式 情報・通信業	1,019,400	3,979.10 4,056,301,084	4,187.00 4,268,227,800	— —	0.96
23	東京海上ホールディングス	株式 保険業	1,280,500	2,721.16 3,484,455,422	3,259.00 4,173,149,500	— —	0.94
24	オリエンタルランド	株式 サービス業	715,600	4,347.10 3,110,786,535	5,450.00 3,900,020,000	— —	0.88
25	ソフトバンク	株式 情報・通信業	2,120,300	1,529.44 3,242,873,300	1,578.00 3,345,833,400	— —	0.75
26	村田製作所	株式 電気機器	398,900	7,722.21 3,080,390,194	8,325.00 3,320,842,500	— —	0.75
27	SMC	株式 機械	43,100	68,001.90 2,930,882,070	74,150.00 3,195,865,000	— —	0.72
28	セブン&アイ・ホールディングス	株式 小売業	479,600	5,948.12 2,852,721,959	5,893.00 2,826,282,800	— —	0.63
29	三菱電機	株式 電気機器	1,373,000	1,514.05 2,078,800,490	2,051.00 2,816,023,000	— —	0.63
30	ファナック	株式 電気機器	641,400	4,622.76 2,965,038,536	4,348.00 2,788,807,200	— —	0.63

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)

株式	97.52
合計	97.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	17.56
情報・通信業		7.90
輸送用機器		7.89
卸売業		6.78
銀行業		6.39
化学		5.83
機械		5.38
医薬品		4.83
サービス業		4.79
小売業		4.25
食料品		3.17
陸運業		2.84
精密機器		2.46
保険業		2.24
その他製品		2.24
建設業		2.00
不動産業		1.77
電気・ガス業		1.27
その他金融業		1.13
鉄鋼		0.92
証券、商品先物取引業		0.72
ゴム製品		0.68
非鉄金属		0.67
ガラス・土石製品		0.66
海運業		0.58
金属製品		0.50
空運業		0.50
石油・石炭製品		0.42
繊維製品		0.42
鉱業		0.32
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業		0.08
合計		97.52

(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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	144回 利付国庫債券 (5年)	国債証 券	4,530,000,000	100.32	100.23	0.1	0.98

		日本			4,544,681,000	4,540,645,500	2025/6/20	
2	350回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,460,000,000	99.64	99.81	0.1	0.96
		日本			4,444,325,000	4,451,749,000	2028/3/20	
3	145回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	4,250,000,000	100.36	100.24	0.1	0.92
		日本			4,265,455,000	4,260,412,500	2025/9/20	
4	366回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,280,000,000	98.22	97.47	0.2	0.90
		日本			4,204,150,000	4,171,972,800	2032/3/20	
5	364回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,250,000,000	97.44	97.06	0.1	0.89
		日本			4,141,334,000	4,125,135,000	2031/9/20	
6	153回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	4,110,000,000	99.89	99.78	0.005	0.88
		日本			4,105,520,000	4,101,204,600	2027/6/20	
7	343回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,090,000,000	100.32	100.25	0.1	0.88
		日本			4,103,120,000	4,100,593,100	2026/6/20	
8	359回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,150,000,000	98.40	98.28	0.1	0.88
		日本			4,083,600,000	4,078,869,000	2030/6/20	
9	348回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,070,000,000	99.80	100.08	0.1	0.88
		日本			4,061,885,000	4,073,337,400	2027/9/20	
10	360回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,100,000,000	98.67	97.98	0.1	0.86
		日本			4,045,556,000	4,017,426,000	2030/9/20	
11	339回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,980,000,000	100.99	100.80	0.4	0.86
		日本			4,019,402,000	4,011,879,800	2025/6/20	
12	369回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,020,000,000	100.88	99.50	0.5	0.86
		日本			4,055,770,000	4,000,261,800	2032/12/20	
13	352回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,850,000,000	99.52	99.49	0.1	0.82
		日本			3,831,798,000	3,830,403,500	2028/9/20	
14	353回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,790,000,000	99.73	99.36	0.1	0.81
		日本			3,779,767,000	3,765,781,900	2028/12/20	
15	143回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	3,700,000,000	100.32	100.21	0.1	0.80
		日本			3,711,860,000	3,707,844,000	2025/3/20	
16	347回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,690,000,000	100.04	100.15	0.1	0.79
		日本			3,691,476,000	3,695,719,500	2027/6/20	
17	351回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,690,000,000	99.52	99.66	0.1	0.79
		日本			3,672,288,000	3,677,454,000	2028/6/20	
18	341回 利付国庫債券 (10年)		国債証 券	3,620,000,000	100.90	100.73	0.3	0.78

	日本			3,652,580,000	3,646,751,800	2025/12/20	
19	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,750,000,000	99.41 3,728,124,000	96.99 3,637,387,500	0.2 2032/9/20	0.78
20	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,710,000,000	97.71 3,625,181,000	97.52 3,618,177,500	0.1 2031/3/20	0.78
21	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,700,000,000	98.79 3,655,499,000	97.24 3,597,917,000	0.2 2032/6/20	0.77
22	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,570,000,000	100.36 3,582,910,000	100.25 3,578,925,000	0.1 2026/9/20	0.77
23	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,550,000,000	99.80 3,542,900,000	99.95 3,548,438,000	0.1 2027/12/20	0.76
24	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,520,000,000	100.35 3,532,488,000	100.26 3,529,257,600	0.1 2026/3/20	0.76
25	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,600,000,000	97.99 3,527,640,000	97.77 3,519,972,000	0.1 2030/12/20	0.76
26	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,630,000,000	97.21 3,528,723,000	96.85 3,515,945,400	0.1 2031/12/20	0.76
27	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,570,000,000	97.62 3,485,034,000	97.29 3,473,502,900	0.1 2031/6/20	0.75
28	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,410,000,000	100.79 3,436,939,000	100.67 3,432,881,100	0.5 2024/9/20	0.74
29	149回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	3,380,000,000	100.06 3,382,298,000	99.95 3,378,377,600	0.005 2026/9/20	0.73
30	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,340,000,000	101.11 3,377,118,400	100.88 3,369,625,800	0.4 2025/9/20	0.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	80.57
地方債証券	6.73
特殊債券	6.38
社債券	5.45
合計	99.13

(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。

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,218,193	21,883.25 48,541,288,098	27,606.15 61,235,779,999	— —	5.55
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	991,596	38,754.61 38,428,918,552	47,700.01 47,299,147,941	— —	4.28
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,295,404	14,212.13 18,410,461,259	18,637.64 24,143,278,199	— —	2.19
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	346,525	34,051.59 11,799,729,744	65,903.47 22,837,201,674	— —	2.07
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	835,893	13,602.06 11,369,870,365	18,689.80 15,622,675,164	— —	1.42
6	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	400,442	29,423.58 11,782,439,815	37,560.04 15,040,620,260	— —	1.36
7	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	309,915	26,065.69 8,078,148,880	45,882.91 14,219,803,788	— —	1.29
8	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	753,544	13,561.12 10,218,906,151	18,750.41 14,129,266,262	— —	1.28
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイダー ／ヘルス ケア・ サービス	130,719	69,362.17 9,066,953,780	70,895.22 9,267,352,616	— —	0.84
10	JPMORGAN CHASE & CO	株式	410,128	20,036.29	22,119.60	—	0.82

	アメリカ	銀行		8,217,446,884	9,071,868,416	—	
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	182,353	43,942.63 8,013,071,561	49,312.71 8,992,321,646	— —	0.81
12	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	363,483	22,736.03 8,264,161,455	24,596.44 8,940,389,836	— —	0.81
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	567,794	16,355.45 9,286,531,769	14,683.43 8,337,166,405	— —	0.76
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	227,383	32,302.46 7,345,031,728	33,233.67 7,556,773,290	— —	0.68
15	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	58,337	86,467.43 5,044,250,702	126,843.39 7,399,663,209	— —	0.67
16	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	113,132	49,385.07 5,587,032,181	64,631.92 7,311,939,006	— —	0.66
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	330,357	19,799.00 6,540,741,177	22,049.11 7,284,080,376	— —	0.66
18	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	384,822	17,994.14 6,924,544,603	17,392.31 6,692,947,367	— —	0.61
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	141,711	44,435.39 6,296,983,673	46,713.22 6,619,778,380	— —	0.60
20	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	119,102	52,104.14 6,205,707,463	55,395.57 6,597,723,321	— —	0.60
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	56,393	96,440.42 5,438,564,688	101,443.54 5,720,706,115	— —	0.52
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	251,757	24,182.87 6,088,208,851	22,395.90 5,638,325,578	— —	0.51
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	355,630	15,348.01 5,458,214,621	14,990.74 5,331,160,351	— —	0.48
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	247,235	21,547.06 5,327,188,135	21,265.32 5,257,532,502	— —	0.48
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	192,695	24,898.29 4,797,776,008	26,828.00 5,169,621,594	— —	0.47
26	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	232,050	21,018.94 4,877,446,948	22,034.28 5,113,054,674	— —	0.46
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	574,262	8,441.07 4,847,389,144	8,807.80 5,057,988,059	— —	0.46
28	LVMH MOET HENNESSY LOUIS	株式	38,691	126,527.67	130,680.41	—	0.46

	VUITTON SE	フランス	繊維・アパレル・贅沢品		4,895,482,082	5,056,156,130	—	
29	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式会社 生活必需品流通・小売り	62,083	70,871.85 4,399,937,302	79,411.22 4,930,086,796	— —	0.45
30	ADOBE INC	アメリカ	株式会社 ソフトウェア	64,328	53,392.47 3,434,631,318	74,554.80 4,795,961,425	— —	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	96.30
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.84
合計	98.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
ソフトウェア	外国	7.95
半導体・半導体製造装置		6.14
コンピュータ・周辺機器		5.75
銀行		5.39
医薬品		4.99
石油・ガス・消耗燃料		4.50
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.11
資本市場		3.05
金融サービス		3.03
保険		2.97
大規模小売り		2.61
ヘルスケア機器・用品		2.36
ホテル・レストラン・レジャー		2.09
自動車		2.07
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.06
化学		1.94
機械		1.85
バイオテクノロジー		1.84
飲料		1.73
生活必需品流通・小売り		1.71
電力		1.69
航空宇宙・防衛		1.63
専門小売り		1.62
食品		1.57
金属・鉱業		1.51

繊維・アパレル・贅沢品	1.33
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.31
情報技術サービス	1.26
娯楽	1.10
家庭用品	1.08
陸上運輸	1.08
専門サービス	1.00
各種電気通信サービス	0.91
コングロマリット	0.90
電気設備	0.84
総合公益事業	0.77
メディア	0.71
通信機器	0.63
建設関連製品	0.62
タバコ	0.59
パーソナルケア用品	0.59
航空貨物・物流サービス	0.58
商業サービス・用品	0.52
電子装置・機器・部品	0.51
商社・流通業	0.42
不動産管理・開発	0.36
消費者金融	0.36
家庭用耐久財	0.30
建設・土木	0.30
建設資材	0.29
エネルギー設備・サービス	0.28
無線通信サービス	0.23
容器・包装	0.22
自動車用部品	0.19
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13
ガス	0.12
運送インフラ	0.11
販売	0.10
水道	0.10
紙製品・林産品	0.09
海上運輸	0.07
旅客航空輸送	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	96.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,502,740,200	81.41 1,223,394,752	81.40 1,223,265,745	1.25 2031/8/15	0.53

2	US T N/B 1.5 11/30/24 アメリカ	国債証 券	1,268,730,000	94.46 1,198,467,732	95.19 1,207,821,051	1.5 2024/11/30	0.52
3	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証 券	1,071,372,000	103.19 1,105,606,670	101.07 1,082,922,726	4.125 2032/11/15	0.47
4	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,134,808,500	92.10 1,045,165,328	91.81 1,041,896,054	2.875 2032/5/15	0.45
5	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	1,253,223,300	81.59 1,022,534,564	81.74 1,024,412,144	1.125 2031/2/15	0.44
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証 券	1,239,126,300	82.07 1,017,013,843	81.76 1,013,227,761	1.375 2031/11/15	0.44
7	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証 券	1,105,204,800	91.93 1,016,079,420	90.72 1,002,714,316	2.75 2032/8/15	0.44
8	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	1,237,716,600	80.53 996,753,759	80.50 996,458,551	0.875 2030/11/15	0.43
9	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	1,167,231,600	85.39 996,783,271	84.87 990,687,820	1.875 2032/2/15	0.43
10	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	1,161,592,800	84.64 983,269,974	84.37 980,048,550	1.625 2031/5/15	0.43
11	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証 券	976,050,900	99.64 972,594,595	100.21 978,107,927	2.26 2025/2/24	0.42
12	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	1,161,592,800	79.49 923,358,331	79.25 920,562,294	0.625 2030/8/15	0.40
13	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証 券	991,019,100	91.47 906,567,302	91.53 907,150,230	1.5 2026/8/15	0.39
14	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証 券	845,820,000	98.93 836,851,488	97.82 827,449,846	3.75 2026/4/15	0.36
15	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証 券	788,728,000	101.64 801,688,279	102.25 806,495,123	3.03 2026/3/11	0.35
16	US T N/B 3.875 01/15/26 アメリカ	国債証 券	817,626,000	98.44 804,928,268	98.08 801,992,098	3.875 2026/1/15	0.35
17	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証 券	900,798,300	86.43 778,607,627	87.11 784,714,953	1.125 2028/2/29	0.34
18	US T N/B 4.25 12/31/24 アメリカ	国債証 券	775,335,000	99.03 767,876,277	98.67 765,037,581	4.25 2024/12/31	0.33
19	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	835,783,000	90.39 755,498,803	90.58 757,068,121	1.5 2031/5/25	0.33
20	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証 券	806,348,400	90.88 732,812,279	90.50 729,808,291	0.75 2026/3/31	0.32
21	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証 券	803,529,000	89.75 721,170,096	89.97 722,987,768	0.375 2026/1/31	0.31
22	US T N/B 1.375 12/31/28 アメリカ	国債証 券	831,723,000	87.89 731,009,475	86.59 720,236,377	1.375 2028/12/31	0.31
23	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証 券	793,838,500	90.07 715,040,502	90.56 718,903,320	0.75 2028/5/25	0.31
24	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証 券	793,661,100	89.53 710,567,478	89.96 714,046,970	0.75 2026/5/31	0.31
25	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証 券	706,842,500	98.19 694,057,132	97.91 692,076,120	2.5 2030/5/25	0.30
26	US T N/B 4.0 11/15/52	国債証	685,114,200	101.44	99.74	4	0.30

	アメリカ	券		695,025,200	683,347,891	2052/11/15	
27	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	721,766,400	94.71 683,604,498	94.56 682,562,637	2.25 2025/11/15	0.30
28	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	704,850,000	98.35 693,284,821	96.29 678,748,523	3.5 2033/2/15	0.29
29	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証 券	681,986,500	99.74 680,237,187	99.44 678,206,587	2.75 2027/10/25	0.29
30	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証 券	728,814,900	92.21 672,092,183	92.36 673,200,059	1.625 2026/5/15	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

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.72
合計	98.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,733,842	2,364.56 6,464,345,175	2,543.61 6,953,851,634	— —	5.98
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	690,700	6,602.39 4,560,271,424	6,335.23 4,375,744,742	— —	3.76
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	529,691	7,315.36 3,874,882,519	7,801.29 4,132,278,398	— —	3.55
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,837,168	1,667.03 3,062,630,163	1,733.87 3,185,414,154	— —	2.74
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	336,918	4,112.31 1,385,514,349	4,887.98 1,646,849,119	— —	1.42
6	MEITUAN	株式	563,110	2,411.25	2,574.59	—	1.25

	ケイマン諸島	ホテル・ レストラン・レ ジャー		1,357,799,204	1,449,778,501	—	
7	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	570,586	1,562.30 891,429,914	1,713.46 977,678,569	— —	0.84
8	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	306,362	2,802.63 858,622,233	2,826.81 866,030,228	— —	0.74
9	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	10,681,530	95.75 1,022,804,278	80.99 865,186,839	— —	0.74
10	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	60,878	10,158.23 618,413,042	14,144.00 861,058,432	— —	0.74
11	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	369,610	2,179.47 805,554,759	2,305.65 852,194,992	— —	0.73
12	VALE SA ブラジル	株式 金属・鋁 業	378,189	2,269.25 858,206,042	2,014.27 761,777,931	— —	0.65
13	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	261,935	2,654.27 695,248,591	2,773.47 726,469,388	— —	0.62
14	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	707,000	970.52 686,158,777	1,015.19 717,740,744	— —	0.62
15	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	56,296	9,752.18 549,009,228	12,595.66 709,085,810	— —	0.61
16	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,375,350	468.62 644,521,880	491.22 675,610,361	— —	0.58
17	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	251,200	2,379.25 597,669,741	2,688.49 675,350,195	— —	0.58
18	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	219,600	2,658.24 583,750,473	3,046.48 669,007,008	— —	0.58
19	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	215,719	2,859.90 616,936,751	2,823.00 608,974,737	— —	0.52
20	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小 売り	21,670	26,668.04 577,896,465	27,721.88 600,733,336	— —	0.52
21	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー	90,561	6,219.12 563,209,752	6,475.29 586,409,643	— —	0.50

		タ・周辺 機器					
22	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	101,064	5,437.02 549,487,728	5,771.28 583,269,450	— —	0.50
23	POSCO HOLDINGS INC 韓国	株式 金属・鋳 業	8,051	46,272.71 372,541,667	68,399.49 550,684,374	— —	0.47
24	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	110,000	4,276.92 470,462,051	4,903.29 539,362,560	— —	0.46
25	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信 サービス	3,530,278	164.48 580,671,271	151.34 534,283,152	— —	0.46
26	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	6,098,000	84.93 517,947,829	85.77 523,055,950	— —	0.45
27	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	169,351	3,140.72 531,884,707	2,951.85 499,899,392	— —	0.43
28	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	325,867	1,415.31 461,203,228	1,494.30 486,945,665	— —	0.42
29	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	523,712	805.71 421,960,066	886.36 464,200,451	— —	0.40
30	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	8,805,200	56.56 498,107,429	51.70 455,306,325	— —	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	94.10
投資信託受益証券	0.76
投資証券	0.09
合計	94.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
銀行	外国	15.39
半導体・半導体製造装置		8.67
コンピュータ・周辺機器		5.84
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.24
大規模小売り		4.94
石油・ガス・消耗燃料		4.73
金属・鋳業		3.76
自動車		3.04
化学		2.80

保険	2.66
電子装置・機器・部品	2.59
ホテル・レストラン・レジャー	2.51
情報技術サービス	1.88
食品	1.63
無線通信サービス	1.61
不動産管理・開発	1.61
生活必需品流通・小売り	1.55
飲料	1.32
各種電気通信サービス	1.28
コングロマリット	1.23
医薬品	1.22
電気設備	1.17
娯楽	1.07
電力	1.00
繊維・アパレル・贅沢品	0.94
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.90
資本市場	0.89
建設資材	0.89
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.86
金融サービス	0.80
専門小売り	0.74
運送インフラ	0.67
バイオテクノロジー	0.67
パーソナルケア用品	0.67
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.65
消費者金融	0.64
建設・土木	0.62
自動車用部品	0.57
機械	0.53
ガス	0.39
陸上運輸	0.35
タバコ	0.35
旅客航空輸送	0.35
家庭用耐久財	0.34
航空貨物・物流サービス	0.32
海上運輸	0.28
航空宇宙・防衛	0.27
ソフトウェア	0.26
通信機器	0.21
各種消費者サービス	0.20
ヘルスケア機器・用品	0.18
紙製品・林産品	0.17
商社・流通業	0.16
水道	0.10
メディア	0.09
家庭用品	0.08
エネルギー設備・サービス	0.06
商業サービス・用品	0.05
総合公益事業	0.03

レジャー用品		0.03
容器・包装		0.02
建設関連製品		0.02
販売		0.01
合計		94.10

(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

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	2,537,460,000	100.66 2,554,270,672	97.81 2,481,930,225	4.375 2029/4/16	1.97
2	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	2,396,490,000	95.29 2,283,723,139	95.10 2,279,077,639	5.5 2029/2/22	1.81
3	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,973,580,000	106.56 2,103,087,729	107.30 2,117,744,098	7.125 2033/1/17	1.68
4	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	2,114,550,000	89.23 1,887,004,684	90.37 1,910,961,126	4.85 2029/9/30	1.52
5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	1,973,580,000	98.35 1,941,110,379	96.24 1,899,462,203	4.817 2049/3/14	1.51
6	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	2,396,490,000	76.77 1,839,981,741	79.16 1,897,243,209	5.875 2060/1/30	1.51
7	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	2,537,460,000	71.87 1,823,902,283	74.64 1,893,960,144	5.75 2049/9/30	1.50
8	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,832,610,000	100.01 1,832,868,874	97.91 1,794,370,521	4.375 2031/1/23	1.43
9	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	1,973,580,000	93.74 1,850,033,892	90.35 1,783,129,530	4.4 2050/4/16	1.42
10	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証券	1,832,610,000	98.00 1,795,957,800	97.06 1,778,731,266	3.4 2025/4/16	1.41
11	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証券	1,832,610,000	95.89 1,757,453,795	95.42 1,748,828,531	2.875 2025/6/6	1.39
12	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	1,691,640,000	101.90 1,723,867,574	101.20 1,712,002,270	6 2029/8/1	1.36
13	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,832,610,000	89.38 1,638,001,020	89.69 1,643,698,953	3.875 2030/6/12	1.31
14	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証券	2,114,550,000	73.29 1,549,905,540	76.47 1,617,073,777	4.75 2050/1/14	1.28
15	HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	1,550,670,000	102.56	102.12	6.25	1.26

	ハンガリー	券		1,590,405,213	1,583,544,204	2032/9/22	
16	ROMANIA 4.0 02/14/51 ルーマニア	国債証券	2,114,550,000	69.71 1,474,140,911	72.37 1,530,352,698	4 2051/2/14	1.22
17	INDONESIA 3.85 10/15/30 インドネシア	国債証券	1,607,058,000	95.75 1,538,825,231	94.12 1,512,659,235	3.85 2030/10/15	1.20
18	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	1,578,864,000	92.54 1,461,102,807	94.17 1,486,931,643	6 2033/2/22	1.18
19	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25 サウジアラビア	国債証券	1,550,670,000	96.74 1,500,174,546	95.21 1,476,392,907	2.9 2025/10/22	1.17
20	REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27 チリ	国債証券	1,578,864,000	94.06 1,485,219,909	93.01 1,468,568,113	2.75 2027/1/31	1.17
21	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,691,640,000	85.72 1,450,175,940	84.97 1,437,541,648	2.783 2031/1/23	1.14
22	HUNGARY 6.125 05/22/28 ハンガリー	国債証券	1,409,700,000	102.46 1,444,491,396	101.72 1,433,952,478	6.125 2028/5/22	1.14
23	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28 サウジアラビア	国債証券	1,409,700,000	102.07 1,438,916,032	99.43 1,401,711,230	4.75 2028/1/18	1.11
24	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証券	1,409,700,000	97.82 1,379,031,842	98.02 1,381,827,411	5.25 2029/6/16	1.10
25	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,409,700,000	97.51 1,374,639,700	97.03 1,367,852,082	4.5 2029/4/22	1.09
26	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証券	1,409,700,000	96.35 1,358,329,122	96.28 1,357,342,332	2.125 2024/9/30	1.08
27	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	1,409,700,000	98.73 1,391,926,502	96.12 1,355,067,076	3.75 2030/4/16	1.08
28	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,409,700,000	96.56 1,361,206,320	95.51 1,346,404,470	2.5 2025/4/16	1.07
29	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,268,730,000	105.75 1,341,724,270	105.18 1,334,454,819	6.35 2035/2/9	1.06
30	COLOMBIA 7.5 02/02/34 コロンビア	国債証券	1,268,730,000	96.81 1,228,324,679	100.79 1,278,819,879	7.5 2034/2/2	1.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.48
合計	97.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	21,455	560,990.97 12,036,061,414	596,000.00 12,787,180,000	— —	6.40
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	18,892	532,023.92 10,050,996,050	572,000.00 10,806,224,000	— —	5.41
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	59,474	164,395.20 9,777,240,168	169,200.00 10,063,000,800	— —	5.04
4	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	32,039	308,451.90 9,882,490,428	290,700.00 9,313,737,300	— —	4.66
5	GLP投資法人 日本	投資証券	62,125	147,986.30 9,193,648,911	140,100.00 8,703,712,500	— —	4.36
6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	88,155	98,153.12 8,652,688,317	97,500.00 8,595,112,500	— —	4.30
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	27,723	293,326.36 8,131,886,882	280,000.00 7,762,440,000	— —	3.89
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	36,645	179,451.43 6,575,997,700	180,900.00 6,629,080,500	— —	3.32
9	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	41,140	147,657.07 6,074,612,116	153,500.00 6,314,990,000	— —	3.16
10	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	17,469	357,268.87 6,241,129,895	346,500.00 6,053,008,500	— —	3.03
11	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	89,045	58,573.24 5,215,654,654	58,900.00 5,244,750,500	— —	2.63
12	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	55,265	81,086.32 4,481,235,949	84,400.00 4,664,366,000	— —	2.34
13	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	12,578	350,571.19 4,409,484,453	354,000.00 4,452,612,000	— —	2.23
14	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証券	6,350	660,974.44 4,197,187,749	674,000.00 4,279,900,000	— —	2.14
15	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証券	59,309	77,046.78 4,569,567,977	70,600.00 4,187,215,400	— —	2.10
16	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	28,061	155,969.47 4,376,659,554	148,800.00 4,175,476,800	— —	2.09
17	アクティビア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証券	9,649	405,620.76 3,913,834,752	414,000.00 3,994,686,000	— —	2.00
18	三井不動産ロジスティクス	投資証	7,265	499,558.67	506,000.00	—	1.84

	パーク投資法人 日本	券		3,629,293,790	3,676,090,000	—	
19	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	10,701	309,406.27 3,310,956,566	338,000.00 3,616,938,000	— —	1.81
20	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	23,509	163,344.86 3,840,074,356	152,100.00 3,575,718,900	— —	1.79
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	11,781	323,198.44 3,807,600,831	300,500.00 3,540,190,500	— —	1.77
22	イオンリート投資法人 日本	投資証券	22,560	155,849.97 3,515,975,454	149,700.00 3,377,232,000	— —	1.69
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,824	488,050.17 3,330,454,415	472,500.00 3,224,340,000	— —	1.61
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	21,627	149,039.67 3,223,281,008	144,700.00 3,129,426,900	— —	1.57
25	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	13,502	209,801.06 2,832,734,047	222,500.00 3,004,195,000	— —	1.50
26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,807	341,709.67 3,009,437,117	340,500.00 2,998,783,500	— —	1.50
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	25,515	112,958.00 2,882,123,561	113,900.00 2,906,158,500	— —	1.46
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	17,207	159,748.39 2,748,790,573	165,000.00 2,839,155,000	— —	1.42
29	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	35,450	70,714.85 2,506,841,557	73,300.00 2,598,485,000	— —	1.30
30	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	6,351	426,418.53 2,708,184,106	407,000.00 2,584,857,000	— —	1.29

(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

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.74
合計	97.74

(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。

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

2023年7月31日現在

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

1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証 券	423,330	17,023.43 7,206,531,458	17,430.94 7,379,040,041	— —	8.71
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証 券	42,879	108,333.64 4,645,238,452	112,403.83 4,819,764,221	— —	5.69
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証 券	72,567	40,579.99 2,944,768,758	39,687.28 2,879,987,145	— —	3.40
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証 券	308,769	8,407.93 2,596,108,462	8,665.42 2,675,614,889	— —	3.16
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証 券	149,736	15,635.74 2,341,234,251	17,547.94 2,627,559,182	— —	3.10
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証 券	227,600	11,143.92 2,536,356,414	11,419.97 2,599,187,379	— —	3.07
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	133,650	14,753.13 1,971,756,316	17,308.29 2,313,253,840	— —	2.73
8	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	460,697	4,391.27 2,023,047,272	4,481.43 2,064,584,259	— —	2.44
9	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	96,898	20,576.60 1,993,832,211	19,854.21 1,923,833,705	— —	2.27
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	65,157	26,695.81 1,739,418,949	26,238.74 1,709,637,979	— —	2.02
11	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信 託受益 証券	782,932	1,922.49 1,505,179,314	1,926.17 1,508,067,959	— —	1.78
12	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	156,510	9,236.40 1,445,589,091	9,136.26 1,429,916,944	— —	1.69
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	265,876	4,820.10 1,281,550,011	5,000.20 1,329,434,743	— —	1.57
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証 券	72,021	15,968.32 1,150,054,453	17,834.11 1,284,430,774	— —	1.52
15	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	182,988	6,348.41 1,161,682,879	6,784.88 1,241,552,737	— —	1.46
16	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証 券	133,417	7,834.92 1,045,312,677	8,537.14 1,139,000,034	— —	1.34
17	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	53,366	21,390.00 1,141,498,923	20,967.87 1,118,971,766	— —	1.32
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	56,919	18,607.56 1,059,123,911	18,537.55 1,055,139,093	— —	1.24
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	29,361	32,810.42 963,346,903	33,453.59 982,230,876	— —	1.16
20	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	97,941	9,624.25 942,609,453	9,604.28 940,653,384	— —	1.11
21	LINK REIT 香港	投資証 券	1,170,720	817.53 957,102,607	797.32 933,447,836	— —	1.10
22	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証 券	325,814	2,347.11 764,722,091	2,562.83 835,007,392	— —	0.99
23	KIMCO REALTY アメリカ	投資証 券	283,163	2,694.23 762,906,485	2,844.77 805,534,910	— —	0.95
24	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	120,314	6,865.44 826,009,229	6,690.43 804,953,140	— —	0.95

25	UDR INC アメリカ	投資証 券	141,726	5,985.39 848,285,456	5,672.63 803,959,556	— —	0.95
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	79,965	9,567.23 765,044,239	10,035.65 802,501,096	— —	0.95
27	SEGRO PLC イギリス	投資証 券	560,396	1,328.95 744,741,257	1,366.61 765,843,001	— —	0.90
28	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	249,937	2,802.32 700,404,540	3,063.27 765,626,538	— —	0.90
29	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証 券	144,178	4,926.26 710,258,659	5,214.48 751,813,340	— —	0.89
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証 券	48,986	15,634.63 765,878,165	15,296.65 749,321,927	— —	0.88

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	10.30
投資証券	89.41
合計	99.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)

該当事項はありません。

D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)

該当事項はありません。

D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

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。

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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

③【その他投資資産の主要なもの】

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

該当事項はありません。

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

該当事項はありません。

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0509月	買建	475	10,811,626,750	11,053,250,000	2.48

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep23	買建	447	14,238,937,406	14,513,605,116	1.31
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep23	買建	413	2,817,287,785	2,883,971,772	0.26
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep23	買建	60	819,631,926	835,458,840	0.08
	モンテリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep23	買建	25	649,431,140	656,117,800	0.06
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep23	買建	23	390,572,928	397,476,639	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。

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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Sep23	買建	790	5,607,004,921	5,870,117,673	5.05

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

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

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。

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	T R E I T 先物 0 5 0 9 月	買建	2,337	4,315,293,870	4,357,336,500	2.18

(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。

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。

(3) 【運用実績】

①【純資産の推移】

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)

直近日(2023年7月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第2計算期間末 (2014年1月14日)	127	127	1.2100	1.2100
第3計算期間末 (2015年1月13日)	330	330	1.3314	1.3314
第4計算期間末 (2016年1月12日)	512	512	1.3081	1.3081
第5計算期間末 (2017年1月11日)	792	792	1.3892	1.3892
第6計算期間末 (2018年1月11日)	1,056	1,056	1.4668	1.4668
第7計算期間末	7,043	7,043	1.4186	1.4186

(2019年1月11日)				
第8計算期間末 (2020年1月14日)	8,245	8,245	1.5303	1.5303
第9計算期間末 (2021年1月12日)	8,888	8,888	1.5646	1.5646
第10計算期間末 (2022年1月11日)	9,852	9,852	1.6543	1.6543
第11計算期間末 (2023年1月11日)	9,953	9,953	1.5794	1.5794
2022年7月末日	10,054	—	1.6320	—
8月末日	10,141	—	1.6347	—
9月末日	9,909	—	1.5900	—
10月末日	10,120	—	1.6192	—
11月末日	10,135	—	1.6157	—
12月末日	9,911	—	1.5720	—
2023年1月末日	10,083	—	1.5905	—
2月末日	10,181	—	1.6081	—
3月末日	10,820	—	1.6190	—
4月末日	10,946	—	1.6342	—
5月末日	11,048	—	1.6549	—
6月末日	11,441	—	1.6972	—
7月末日	11,411	—	1.6888	—

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

直近日（2023年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第2計算期間末 (2014年1月14日)	118	118	1.3404	1.3404
第3計算期間末 (2015年1月13日)	420	420	1.5397	1.5397
第4計算期間末 (2016年1月12日)	658	658	1.4776	1.4776
第5計算期間末 (2017年1月11日)	1,034	1,034	1.6142	1.6142
第6計算期間末 (2018年1月11日)	1,740	1,740	1.7637	1.7637
第7計算期間末 (2019年1月11日)	3,092	3,092	1.6601	1.6601
第8計算期間末 (2020年1月14日)	4,278	4,278	1.8760	1.8760
第9計算期間末 (2021年1月12日)	5,107	5,107	1.9322	1.9322
第10計算期間末 (2022年1月11日)	6,618	6,618	2.1285	2.1285
第11計算期間末 (2023年1月11日)	7,704	7,704	2.0338	2.0338
2022年7月末日	7,718	—	2.1028	—

8月末日	7,791	—	2,1130	—
9月末日	7,537	—	2,0284	—
10月末日	7,827	—	2,0893	—
11月末日	7,871	—	2,0908	—
12月末日	7,632	—	2,0145	—
2023年1月末日	7,848	—	2,0584	—
2月末日	7,955	—	2,0807	—
3月末日	8,100	—	2,0822	—
4月末日	8,259	—	2,1111	—
5月末日	8,427	—	2,1561	—
6月末日	8,889	—	2,2420	—
7月末日	8,929	—	2,2447	—

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

直近日（2023年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第2計算期間末 (2014年1月14日)	199	199	1,4785	1,4785
第3計算期間末 (2015年1月13日)	764	764	1,7713	1,7713
第4計算期間末 (2016年1月12日)	1,057	1,057	1,6586	1,6586
第5計算期間末 (2017年1月11日)	1,555	1,555	1,8583	1,8583
第6計算期間末 (2018年1月11日)	2,582	2,582	2,1012	2,1012
第7計算期間末 (2019年1月11日)	4,022	4,022	1,9213	1,9213
第8計算期間末 (2020年1月14日)	5,610	5,610	2,2720	2,2720
第9計算期間末 (2021年1月12日)	6,419	6,419	2,3400	2,3400
第10計算期間末 (2022年1月11日)	8,927	8,927	2,6787	2,6787
第11計算期間末 (2023年1月11日)	9,373	9,373	2,5595	2,5595
2022年7月末日	9,351	—	2,6483	—
8月末日	9,440	—	2,6697	—
9月末日	9,074	—	2,5287	—
10月末日	9,498	—	2,6351	—
11月末日	9,599	—	2,6443	—
12月末日	9,234	—	2,5226	—
2023年1月末日	9,574	—	2,6035	—
2月末日	9,704	—	2,6311	—
3月末日	9,836	—	2,6175	—
4月末日	9,983	—	2,6660	—
5月末日	10,297	—	2,7464	—

6月末日	11,042	—	2.8956	—
7月末日	11,131	—	2.9175	—

②【分配の推移】

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

	1口当たりの分配金（円）
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
2023年1月12日～2023年7月11日	—

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

	1口当たりの分配金（円）
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
2023年1月12日～2023年7月11日	—

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

	1口当たりの分配金（円）
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
2023年1月12日～2023年7月11日	—

③【収益率の推移】

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

	収益率（%）

第2計算期間	12.1
第3計算期間	10.0
第4計算期間	△1.8
第5計算期間	6.2
第6計算期間	5.6
第7計算期間	△3.3
第8計算期間	7.9
第9計算期間	2.2
第10計算期間	5.7
第11計算期間	△4.5
2023年1月12日～2023年7月11日	6.2

(注) 収益率は期間騰落率です。

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)

	収益率(%)
第2計算期間	18.1
第3計算期間	14.9
第4計算期間	△4.0
第5計算期間	9.2
第6計算期間	9.3
第7計算期間	△5.9
第8計算期間	13.0
第9計算期間	3.0
第10計算期間	10.2
第11計算期間	△4.4
2023年1月12日～2023年7月11日	8.4

(注) 収益率は期間騰落率です。

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)

	収益率(%)
第2計算期間	24.0
第3計算期間	19.8
第4計算期間	△6.4
第5計算期間	12.0
第6計算期間	13.1
第7計算期間	△8.6
第8計算期間	18.3
第9計算期間	3.0
第10計算期間	14.5
第11計算期間	△4.4
2023年1月12日～2023年7月11日	10.7

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)

	設定口数	解約口数
第2計算期間	111,676,677	6,418,057
第3計算期間	191,123,974	48,604,966
第4計算期間	260,665,787	117,532,208
第5計算期間	262,202,825	82,821,677

第6計算期間	291,106,374	141,518,655
第7計算期間	4,495,262,603	250,378,156
第8計算期間	771,650,558	348,939,279
第9計算期間	779,738,086	486,612,499
第10計算期間	793,624,600	518,927,965
第11計算期間	772,352,210	426,006,556
2023年1月12日～ 2023年7月11日	674,696,263	235,676,995

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)

	設定口数	解約口数
第2計算期間	92,815,520	5,246,291
第3計算期間	228,989,766	44,243,208
第4計算期間	245,786,975	72,842,093
第5計算期間	279,729,076	84,404,037
第6計算期間	469,630,383	123,925,495
第7計算期間	1,020,882,019	144,579,473
第8計算期間	608,761,946	191,262,701
第9計算期間	637,017,771	274,298,215
第10計算期間	752,122,154	285,922,797
第11計算期間	1,012,283,711	333,793,374
2023年1月12日～ 2023年7月11日	349,050,107	171,041,113

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

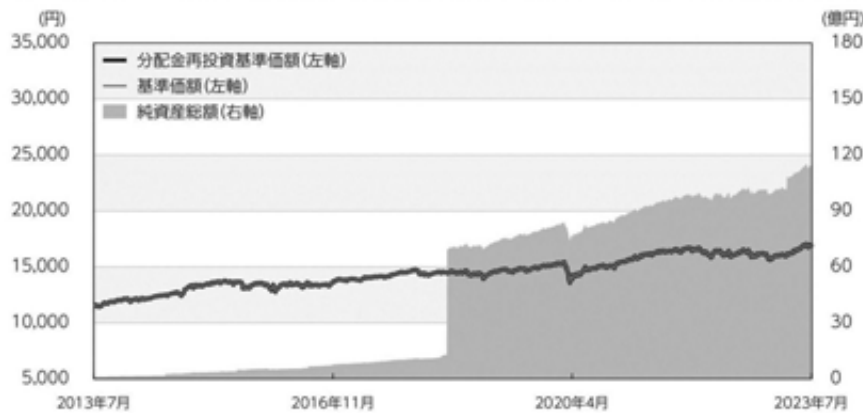
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)

	設定口数	解約口数
第2計算期間	149,907,733	15,606,518
第3計算期間	423,497,480	126,497,569
第4計算期間	458,779,190	253,200,673
第5計算期間	385,635,483	185,968,924
第6計算期間	663,783,354	271,611,091
第7計算期間	1,131,364,584	267,113,683
第8計算期間	729,100,474	353,003,717
第9計算期間	872,226,324	598,311,991
第10計算期間	1,138,774,572	549,449,446
第11計算期間	935,702,228	606,213,806
2023年1月12日～ 2023年7月11日	418,811,014	269,083,768

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

基準価額・純資産の推移 (2013年7月31日~2023年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
 (設定日:2012年9月6日)

分配の推移(税引前)

2019年 1月	0円
2020年 1月	0円
2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	54.69
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.67
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10.66
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.53
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.12
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.31
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.01
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	3.00

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。
 ※2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

- 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。

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

基準価額・純資産の推移 (2013年7月31日～2023年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2012年9月6日)

分配の推移(税引前)

2019年 1月	0円
2020年 1月	0円
2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
設定来累計	0円

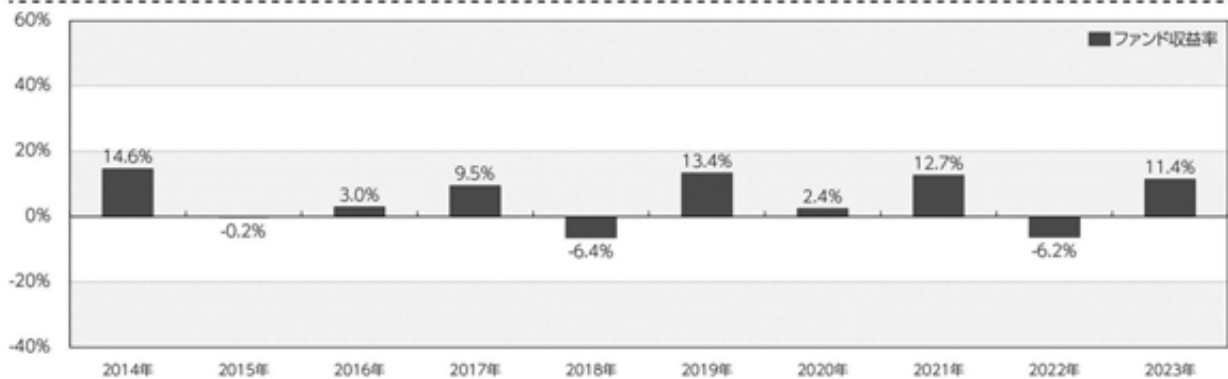
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	30.42
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.41
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	15.28
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	10.45
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	9.72
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.14
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	5.84
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.74

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。

※2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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。

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

基準価額・純資産の推移 (2013年7月31日~2023年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2012年9月6日)

分配の推移(税引前)

2019年 1月	0円
2020年 1月	0円
2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
設定来累計	0円

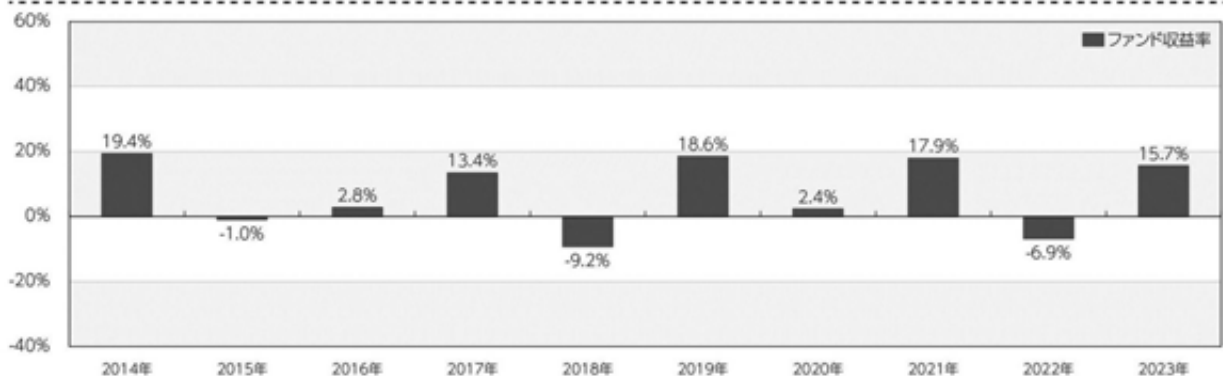
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.21
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.18
3	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	15.25
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	14.82
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	8.95
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.94
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.84
8	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.81

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。

※2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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。

主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.87
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.78
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.09
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.88
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.55

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	144回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/6/20	0.98
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	0.96
3	145回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	0.92
4	366回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.2	2032/3/20	0.90
5	364回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2031/9/20	0.89

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.55
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.28
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.19
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.07
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.42

■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	0.53
2	US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	アメリカ	1.5	2024/11/30	0.52
3	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.47
4	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	0.45
5	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.44

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

■エマーシング株式パッシブ・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	5.98
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.76
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.55
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.74
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.42

■エマーシング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	1.97
2	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	1.81
3	ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	ルーマニア	7.125	2033/1/17	1.68
4	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国債証券	南アフリカ	4.85	2029/9/30	1.52
5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.51

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.40
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.41
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.04
4	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.66
5	GLP投資法人	投資証券	日本	4.36

■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	8.71
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.69
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.40
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.16
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.10

○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】

・お申込みの方法

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。

ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積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は、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。

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

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、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

※受益権の取得申込者は、委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

※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 <https://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）

- ・お申込単位

1口以上1口単位または1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

- ・お申込手数料

ありません。

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

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

- ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※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

1口単位とします。

・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6営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

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
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は2012年9月6日から無期限です。

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

(4) 【計算期間】

a. 計算期間は原則として、毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

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

(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有利であると認めるとき、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する

委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し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ます。
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあつては、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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、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つても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場

合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

ニ. 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 <https://www.am-one.co.jp/>)

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

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年1月11日（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 <https://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に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けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、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。

③一部解約請求権

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間（2022年1月12日から2023年1月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年3月10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DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）の2022年1月12日から2023年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）の2023年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記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。

1【財務諸表】

【DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	421,924,621	428,672,714
親投資信託受益証券	9,456,730,000	9,553,136,234
未収入金	11,168,000	—
流動資産合計	9,889,822,621	9,981,808,948
資産合計		
	9,889,822,621	9,981,808,948
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,790,872	10,760,296
未払受託者報酬	1,876,736	1,948,982
未払委託者報酬	15,014,197	15,592,242
その他未払費用	190,800	198,154
流動負債合計	36,872,605	28,499,674
負債合計		
	36,872,605	28,499,674
純資産の部		
元本等		
元本	5,955,798,022	6,302,143,676
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,897,151,994	3,651,165,598
（分配準備積立金）	1,098,345,050	1,133,640,334
元本等合計	9,852,950,016	9,953,309,274
純資産合計		
	9,852,950,016	9,953,309,274
負債純資産合計		
	9,889,822,621	9,981,808,948

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	第11期 自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
営業収益		
受取利息	1,308	2,857
有価証券売買等損益	550,095,796	△424,004,766
営業収益合計	550,097,104	△424,001,909
営業費用		
支払利息	84,983	152,764
受託者報酬	3,633,684	3,815,237
委託者報酬	29,070,178	30,522,595
その他費用	369,414	387,899
営業費用合計	33,158,259	34,878,495
営業利益又は営業損失(△)	516,938,845	△458,880,404
経常利益又は経常損失(△)	516,938,845	△458,880,404
当期純利益又は当期純損失(△)	516,938,845	△458,880,404
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(△)	31,019,546	△15,250,952
期首剰余金又は期首欠損金(△)	3,207,573,389	3,897,151,994
剰余金増加額又は欠損金減少額	498,221,720	475,509,727
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	498,221,720	475,509,727
剰余金減少額又は欠損金増加額	294,562,414	277,866,671
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	294,562,414	277,866,671
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,897,151,994	3,651,165,598

(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 2022年1月12日	至 2023年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期	第11期
	2022年1月11日現在	2023年1月11日現在
1. 期首元本額	5,681,101,387円	5,955,798,022円
期中追加設定元本額	793,624,600円	772,352,210円
期中一部解約元本額	518,927,965円	426,006,556円
2. 受益権の総数	5,955,798,022口	6,302,143,676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1月13日 至 2022年1月11日	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(116,888,693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(369,030,606円)、信託約款に規定される収益調整金(2,798,806,944円)及び分配準備積立金(612,425,751円)より分配対象収益は3,897,151,994円(1万口当たり6,543.45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(109,074,791円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,517,525,264円)及び分配準備積立金(1,024,565,543円)より分配対象収益は3,651,165,598円(1万口当たり5,793.52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	第11期
	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左
-------------------	---	----

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた	当期の 損益に含まれた

	評価差額 (円)	評価差額 (円)
親投資信託受益証券	495,852,564	△426,708,418
合計	495,852,564	△426,708,418

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,6543円 (16,543円)	1,5794円 (15,794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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	306,201,964	990,563,353	
	国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	4,592,822,348	5,671,217,035	
	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド	125,636,380	290,232,601	
	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	170,887,344	1,008,679,636	
	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	146,595,885	294,525,792	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	185,757,051	294,369,198	
	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	366,379,426	516,338,525	
	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	250,043,672	487,210,094	
親投資信託受益証券 合計		6,144,324,070	9,553,136,234	
合計			9,553,136,234	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

2023年3月10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DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）の2022年1月12日から2023年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）の2023年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記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。

【DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	220,241,203	249,779,747
親投資信託受益証券	6,416,446,661	7,474,001,701
未収入金	2,741,000	—
流動資産合計	6,639,428,864	7,723,781,448
資産合計	6,639,428,864	7,723,781,448
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,540,827	4,693,375
未払受託者報酬	1,233,247	1,499,861
未払委託者報酬	10,923,420	13,284,898
その他未払費用	125,353	152,467
流動負債合計	20,822,847	19,630,601
負債合計	20,822,847	19,630,601
純資産の部		
元本等		
元本	3,109,511,300	3,788,001,637
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,509,094,717	3,916,149,210
（分配準備積立金）	1,058,944,438	1,085,210,372
元本等合計	6,618,606,017	7,704,150,847
純資産合計	6,618,606,017	7,704,150,847
負債純資産合計	6,639,428,864	7,723,781,448

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	第11期 自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
営業収益		
受取利息	671	1,644
有価証券売買等損益	568,593,349	△292,740,960
営業収益合計	568,594,020	△292,739,316
営業費用		
支払利息	42,643	88,077
受託者報酬	2,289,563	2,769,873
委託者報酬	20,279,728	24,533,899
その他費用	232,726	281,553
営業費用合計	22,844,660	27,673,402
営業利益又は営業損失(△)	545,749,360	△320,412,718
経常利益又は経常損失(△)	545,749,360	△320,412,718
当期純利益又は当期純損失(△)	545,749,360	△320,412,718
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(△)	33,289,537	△14,109,658
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,464,049,276	3,509,094,717
剰余金増加額又は欠損金減少額	802,924,125	1,087,647,165
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	802,924,125	1,087,647,165
剰余金減少額又は欠損金増加額	270,338,507	374,289,612
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	270,338,507	374,289,612
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,509,094,717	3,916,149,210

(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 2022年1月12日	至 2023年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期	第11期
	2022年1月11日現在	2023年1月11日現在
1. 期首元本額	2,643,311,943円	3,109,511,300円
期中追加設定元本額	752,122,154円	1,012,283,711円
期中一部解約元本額	285,922,797円	333,793,374円
2. 受益権の総数	3,109,511,300口	3,788,001,637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1月13日 至 2022年1月11日	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(104,414,501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(408,045,322円)、信託約款に規定される収益調整金(2,450,150,279円)及び分配準備積立金(546,484,615円)より分配対象収益は3,509,094,717円(1万口当たり11,285.03円)ですが、分配を行っていません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(124,424,745円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,830,938,838円)及び分配準備積立金(960,785,627円)より分配対象収益は3,916,149,210円(1万口当たり10,338.29円)ですが、分配を行っていません。

(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	第11期
	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左
-------------------	---	----

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた	当期の 損益に含まれた

	評価差額 (円)	評価差額 (円)
親投資信託受益証券	553,665,434	△294,104,140
合計	553,665,434	△294,104,140

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,1285円 (21,285円)	2,0338円 (20,338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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	356,000,978	1,151,663,163	
	国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	1,937,579,442	2,392,523,094	
	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド	192,913,663	445,649,852	
	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	197,773,572	1,167,378,286	
	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	150,866,647	303,106,180	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	288,624,187	457,382,749	
	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	568,786,720	801,591,124	
	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	387,327,305	754,707,253	
親投資信託受益証券 合計		4,079,872,514	7,474,001,701	
合計			7,474,001,701	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

2023年3月10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DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）の2022年1月12日から2023年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）の2023年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記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。

【DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	220,138,608	216,508,547
親投資信託受益証券	8,745,776,381	9,189,044,065
流動資産合計	8,965,914,989	9,405,552,612
資産合計	8,965,914,989	9,405,552,612
負債の部		
流動負債		
未払解約金	20,568,682	12,269,367
未払受託者報酬	1,633,723	1,820,941
未払委託者報酬	15,870,753	17,689,515
その他未払費用	166,086	185,125
流動負債合計	38,239,244	31,964,948
負債合計	38,239,244	31,964,948
純資産の部		
元本等		
元本	3,332,805,582	3,662,294,004
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,594,870,163	5,711,293,660
（分配準備積立金）	1,649,751,536	1,601,236,439
元本等合計	8,927,675,745	9,373,587,664
純資産合計	8,927,675,745	9,373,587,664
負債純資産合計	8,965,914,989	9,405,552,612

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	第11期 自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
営業収益		
受取利息	634	1,472
有価証券売買等損益	1,024,046,074	△375,650,316
営業収益合計	1,024,046,708	△375,648,844
営業費用		
支払利息	39,573	78,449
受託者報酬	3,005,256	3,512,874
委託者報酬	29,194,645	34,125,836
その他費用	305,506	357,125
営業費用合計	32,544,980	38,074,284
営業利益又は営業損失(△)	991,501,728	△413,723,128
経常利益又は経常損失(△)	991,501,728	△413,723,128
当期純利益又は当期純損失(△)	991,501,728	△413,723,128
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(△)	103,090,440	△41,782,943
期首剰余金又は期首欠損金(△)	3,676,313,151	5,594,870,163
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,782,070,385	1,500,093,174
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	1,782,070,385	1,500,093,174
剰余金減少額又は欠損金増加額	751,924,661	1,011,729,492
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	751,924,661	1,011,729,492
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(△)	5,594,870,163	5,711,293,660

(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 2022年1月12日	至 2023年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期	第11期
	2022年1月11日現在	2023年1月11日現在
1. 期首元本額	2,743,480,456円	3,332,805,582円
期中追加設定元本額	1,138,774,572円	935,702,228円
期中一部解約元本額	549,449,446円	606,213,806円
2. 受益権の総数	3,332,805,582口	3,662,294,004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1月13日 至 2022年1月11日	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(177,008,308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(711,402,980円)、信託約款に規定される収益調整金(3,945,118,627円)及び分配準備積立金(761,340,248円)より分配対象収益は5,594,870,163円(1万口当たり16,787.26円)ですが、分配を行っていません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(214,941,465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(4,110,057,221円)及び分配準備積立金(1,386,294,974円)より分配対象収益は5,711,293,660円(1万口当たり15,594.85円)ですが、分配を行っていません。

(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	第11期
	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左
-------------------	---	----

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた	当期の 損益に含まれた

	評価差額 (円)	評価差額 (円)
親投資信託受益証券	1,003,524,531	△376,293,547
合計	1,003,524,531	△376,293,547

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第10期 2022年1月11日現在	第11期 2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,6787円 (26,787円)	2,5595円 (25,595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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	576,024,312	1,863,438,649	
	国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	377,779,353	466,481,945	
	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド	355,658,204	821,606,017	
	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	320,757,125	1,893,301,006	
	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	229,942,536	461,977,549	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	529,206,361	838,633,320	
	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	1,041,246,012	1,467,428,004	
	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	706,275,379	1,376,177,575	
親投資信託受益証券 合計		4,136,889,282	9,189,044,065	
合計			9,189,044,065	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・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、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,030,245,593
株式	353,679,998,270
派生商品評価勘定	31,691,230
未収配当金	605,141,059
前払金	258,565,000
差入委託証拠金	506,220,000
流動資産合計	367,111,861,152
資産合計	367,111,861,152
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	163,940,810
未払解約金	898,304,000
流動負債合計	1,062,244,810
負債合計	1,062,244,810
純資産の部	
元本等	
元本	113,153,180,874
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	252,896,435,468
元本等合計	366,049,616,342
純資産合計	366,049,616,342
負債純資産合計	367,111,861,152

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年1月12日
	至 2023年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	140,692,906,135円
同期中追加設定元本額	126,890,517,939円
同期中一部解約元本額	154,430,243,200円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,646,476,823円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	4,049,495,093円
One DC 国内株式インデックスファンド	24,547,694,881円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,902,547,555円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,104,079円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	16,922,410円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	44,353,151円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	26,541,745円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	23,505,480円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,002,416円
たわらノーロード TOPIX	1,707,918,547円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,439,950,089円
たわらノーロード バランス（堅実型）	52,388,240円
たわらノーロード バランス（標準型）	346,773,204円
たわらノーロード バランス（積極型）	543,071,139円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	4,367,064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）	193,888,523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）	469,423,866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）	327,070,843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）	459,325,287円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	410,901円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,749,277円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	33,093,014円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,215,832円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,566,600円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,744,062,427円
O n eグローバルバランス	7,018,835円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	1,076,599,868円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,606,198,196円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,964,822,453円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	343,582,135円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,077,764,148円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,129,817,863円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,150,216,258円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,484,653円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	306,201,964円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	356,000,978円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	576,024,312円
投資のソムリエ	5,743,698,687円
クルーズコントロール	69,192,978円
投資のソムリエ<DC年金>	415,188,129円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	371,916,647円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	877,958,248円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	324,548,775円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,409,352,556円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	30,810,443円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	15,446,613円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,231,146円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	50,981,785円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	497,025,127円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	115,999,581円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	276,065,472円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	21,858,666円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	16,535,911円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	10,207,719円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	366,281,074円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	2,140,049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)	20,273,145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)	20,796,102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)	14,888,210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)	12,721,954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)	20,102,661円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	47,431,579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)	181,854,539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)	17,957,278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)	114,572,400円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	515,358,737円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	152,825,216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）	9,586,119円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	30,257,311円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	294,994,531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）	34,611,881円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,027,914円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	3,768,730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）	46,249,953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）	90,479,527円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,440,855円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	20,890,766円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	4,584,891円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	92,241円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	5,991,744円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	26,778,118円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	437,275,013円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	533,483,788円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,565,625,264円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	16,123,588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）	22,544,617円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	230,745,406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）	56,367,147円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	67,452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）	283,402,510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）	16,362,589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）	55,466,457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）	127,280,342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）	178,296,635円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	32,164,906円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	15,753,322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）	11,309,625円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1303）（適格機関投資家限定）	922,255,638円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1306）（適格機関投資家限定）	1,220,307,862円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1309）（適格機関投資家限定）	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	24,646,311円
コア資産形成ファンド	16,525,883円
MHAMトピックスファンド	776,349,832円

MHAM TOPIXファンドVA (適格機関投資家専用)	50,742,120円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,198,759,908円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,497,351,931円
計	113,153,180,874円
2. 受益権の総数	113,153,180,874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 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	2023年1月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	
株式	△3,037,199,780	
合計	△3,037,199,780	

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年2月8日から2023年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	13,918,750,000	—		13,786,740,000
合計	13,918,750,000	—		13,786,740,000
				△132,010,000

(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)

2023年1月11日現在	
1口当たり純資産額	3.2350円
(1万口当たり純資産額)	(32,350円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	6,900	3,725.00	25,702,500	
ニッセイ	181,100	522.00	94,534,200	
マルハニチロ	26,800	2,418.00	64,802,400	
雪国まいたけ	15,400	993.00	15,292,200	
カネコ種苗	5,900	1,453.00	8,572,700	
サカタのタネ	22,900	4,145.00	94,920,500	
ホクト	16,200	1,859.00	30,115,800	
ホクリヨウ	2,500	743.00	1,857,500	
ショーボンドホールディングス	24,600	5,410.00	133,086,000	

ミライト・ワン	62,700	1,514.00	94,927,800
タマホーム	12,700	2,483.00	31,534,100
サンヨーホームズ	2,100	707.00	1,484,700
日本アクア	7,600	818.00	6,216,800
ファーストコーポレーション	4,800	702.00	3,369,600
ベステラ	4,000	944.00	3,776,000
Robot Home	30,800	164.00	5,051,200
キャンディル	2,700	500.00	1,350,000
住石ホールディングス	28,200	392.00	11,054,400
日鉄鉱業	7,200	3,270.00	23,544,000
三井松島ホールディングス	8,000	3,100.00	24,800,000
I N P E X	669,900	1,378.00	923,122,200
石油資源開発	20,900	3,825.00	79,942,500
K&Oエナジーグループ	8,100	1,999.00	16,191,900
ダイセキ環境ソリューション	3,800	944.00	3,587,200
第一カッター興業	4,700	1,022.00	4,803,400
明豊ファシリティワークス	6,600	714.00	4,712,400
安藤・間	104,800	843.00	88,346,400
東急建設	51,600	632.00	32,611,200
コムシスホールディングス	61,300	2,332.00	142,951,600
ビーアールホールディングス	28,800	329.00	9,475,200
高松コンストラクショングループ	11,700	1,912.00	22,370,400
東建コーポレーション	5,800	7,500.00	43,500,000
ソネック	1,900	939.00	1,784,100
ヤマウラ	9,300	1,008.00	9,374,400
オリエンタル白石	65,300	285.00	18,610,500
大成建設	126,100	4,090.00	515,749,000
大林組	453,100	955.00	432,710,500
清水建設	381,000	684.00	260,604,000
飛島建設	14,000	1,006.00	14,084,000
長谷工コーポレーション	130,700	1,456.00	190,299,200
松井建設	11,800	548.00	6,466,400
銭高組	1,500	2,632.00	3,948,000
鹿島建設	281,000	1,491.00	418,971,000
不動テトラ	8,600	1,478.00	12,710,800
大末建設	4,700	1,148.00	5,395,600
鉄建建設	9,200	1,758.00	16,173,600
西松建設	21,500	3,880.00	83,420,000
三井住友建設	102,200	410.00	41,902,000
大豊建設	5,200	4,015.00	20,878,000
佐田建設	8,100	439.00	3,555,900
ナカノフドー建設	9,200	320.00	2,944,000
奥村組	20,500	2,945.00	60,372,500
東鉄工業	17,500	2,566.00	44,905,000
イチケン	2,700	1,781.00	4,808,700
富士ピー・エス	5,900	438.00	2,584,200
浅沼組	10,100	3,000.00	30,300,000
戸田建設	155,900	695.00	108,350,500
熊谷組	21,900	2,551.00	55,866,900
北野建設	2,200	2,459.00	5,409,800

植木組	3,700	1,325.00	4,902,500
矢作建設工業	17,400	763.00	13,276,200
ピーエス三菱	16,100	606.00	9,756,600
日本ハウスホールディングス	25,000	365.00	9,125,000
大東建託	46,600	13,640.00	635,624,000
新日本建設	17,800	754.00	13,421,200
東亜道路工業	2,200	5,760.00	12,672,000
日本道路	2,400	5,770.00	13,848,000
東亜建設工業	10,900	2,325.00	25,342,500
日本国土開発	38,000	552.00	20,976,000
若築建設	5,600	2,743.00	15,360,800
東洋建設	41,100	844.00	34,688,400
五洋建設	179,600	611.00	109,735,600
世紀東急工業	16,800	790.00	13,272,000
福田組	4,400	4,455.00	19,602,000
日本ドライケミカル	3,200	1,470.00	4,704,000
住友林業	97,100	2,343.00	227,505,300
日本基礎技術	8,000	508.00	4,064,000
巴コーポレーション	14,200	396.00	5,623,200
大和ハウス工業	354,100	3,009.00	1,065,486,900
ライト工業	24,100	1,834.00	44,199,400
積水ハウス	396,900	2,385.00	946,606,500
日特建設	12,100	911.00	11,023,100
北陸電気工事	8,600	660.00	5,676,000
ユアテック	28,000	724.00	20,272,000
日本リーテック	8,200	898.00	7,363,600
四電工	5,300	1,732.00	9,179,600
中電工	19,600	2,055.00	40,278,000
関電工	69,500	840.00	58,380,000
きんでん	89,300	1,393.00	124,394,900
東京エネシス	12,500	928.00	11,600,000
トーエネック	4,300	3,450.00	14,835,000
住友電設	12,000	2,342.00	28,104,000
日本電設工業	20,900	1,545.00	32,290,500
エクシオグループ	58,400	2,229.00	130,173,600
新日本空調	7,000	1,848.00	12,936,000
日本工営	9,500	3,300.00	31,350,000
九電工	30,800	3,175.00	97,790,000
三機工業	28,200	1,520.00	42,864,000
日揮ホールディングス	125,300	1,660.00	207,998,000
中外炉工業	4,200	1,614.00	6,778,800
ヤマト	10,700	688.00	7,361,600
太平電業	7,800	3,305.00	25,779,000
高砂熱学工業	30,500	1,733.00	52,856,500
三晃金属工業	1,500	3,075.00	4,612,500
NEC ネットエスアイ	43,200	1,671.00	72,187,200
朝日工業社	5,200	1,975.00	10,270,000
明星工業	21,900	796.00	17,432,400
大気社	15,300	3,320.00	50,796,000
ダイダン	8,200	2,137.00	17,523,400

日比谷総合設備	11,000	1,893.00	20,823,000
ニッポン	34,400	1,578.00	54,283,200
日清製粉グループ本社	117,500	1,602.00	188,235,000
日東富士製粉	2,100	4,260.00	8,946,000
昭和産業	11,200	2,435.00	27,272,000
鳥越製粉	10,300	582.00	5,994,600
中部飼料	17,700	1,022.00	18,089,400
フィード・ワン	18,500	710.00	13,135,000
東洋精糖	1,600	853.00	1,364,800
日本甜菜製糖	7,500	1,634.00	12,255,000
DM三井製糖ホールディングス	12,600	1,967.00	24,784,200
塩水港精糖	15,700	196.00	3,077,200
ウェルネオシュガー	6,500	1,765.00	11,472,500
L I F U L L	45,300	219.00	9,920,700
M I X I	30,200	2,481.00	74,926,200
ジェイエイシーリクルートメント	11,900	2,315.00	27,548,500
日本M&Aセンターホールディングス	227,700	1,721.00	391,871,700
メンバーズ	4,000	1,997.00	7,988,000
中広	1,000	373.00	373,000
UTグループ	19,400	2,445.00	47,433,000
アイティメディア	5,000	1,586.00	7,930,000
E・Jホールディングス	8,400	1,350.00	11,340,000
オープンアップグループ	48,500	1,689.00	81,916,500
コシダカホールディングス	39,800	1,000.00	39,800,000
アルトナー	3,200	1,029.00	3,292,800
パソナグループ	16,100	1,906.00	30,686,600
CDS	3,300	1,752.00	5,781,600
リンクアンドモチベーション	38,100	640.00	24,384,000
エス・エム・エス	50,400	3,350.00	168,840,000
サニーサイドアップグループ	4,700	518.00	2,434,600
パーソルホールディングス	148,600	2,774.00	412,216,400
リニカル	7,500	658.00	4,935,000
クックパッド	36,400	198.00	7,207,200
エスクリ	5,300	318.00	1,685,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,500	643.00	4,179,500
森永製菓	23,500	3,740.00	87,890,000
中村屋	2,700	3,065.00	8,275,500
江崎グリコ	36,400	3,500.00	127,400,000
名糖産業	5,000	1,637.00	8,185,000
井村屋グループ	7,000	2,230.00	15,610,000
不二家	8,600	2,497.00	21,474,200
山崎製パン	85,200	1,496.00	127,459,200
第一屋製パン	2,400	377.00	904,800
モロゾフ	4,200	3,385.00	14,217,000
亀田製菓	8,000	4,290.00	34,320,000
寿スピリッツ	13,400	7,810.00	104,654,000
カルビー	58,300	2,901.00	169,128,300
森永乳業	23,100	4,700.00	108,570,000
六甲バター	9,400	1,245.00	11,703,000
ヤクルト本社	90,800	8,900.00	808,120,000

明治ホールディングス	78,900	6,470.00	510,483,000
雪印メグミルク	30,700	1,702.00	52,251,400
プリマハム	17,200	2,083.00	35,827,600
日本ハム	49,700	3,575.00	177,677,500
林兼産業	3,800	468.00	1,778,400
丸大食品	12,800	1,406.00	17,996,800
S Foods	14,000	2,885.00	40,390,000
柿安本店	4,900	2,050.00	10,045,000
伊藤ハム米久ホールディングス	99,000	680.00	67,320,000
学情	5,900	1,297.00	7,652,300
スタジオアリス	6,600	2,160.00	14,256,000
クロスキャット	7,400	1,377.00	10,189,800
シミックホールディングス	7,300	1,778.00	12,979,400
エプロ	2,700	683.00	1,844,100
システナ	217,900	401.00	87,377,900
N J S	2,500	2,054.00	5,135,000
デジタルアーツ	8,000	5,600.00	44,800,000
日鉄ソリューションズ	22,100	3,215.00	71,051,500
総合警備保障	49,200	3,400.00	167,280,000
キューブシステム	7,700	1,029.00	7,923,300
いちご	146,500	280.00	41,020,000
日本駐車場開発	151,500	281.00	42,571,500
コア	5,700	1,445.00	8,236,500
カカクコム	99,100	2,076.00	205,731,600
アイロムグループ	4,800	2,380.00	11,424,000
セントケア・ホールディング	8,300	811.00	6,731,300
サイネックス	2,100	558.00	1,171,800
ルネサンス	9,300	876.00	8,146,800
ディップ	23,200	3,690.00	85,608,000
S B Sホールディングス	11,500	2,749.00	31,613,500
デジタルホールディングス	10,400	1,242.00	12,916,800
新日本科学	14,000	2,456.00	34,384,000
キャリアデザインセンター	2,600	1,498.00	3,894,800
ベネフィット・ワン	61,500	1,975.00	121,462,500
エムスリー	262,400	3,640.00	955,136,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,500	365.00	3,102,500
プラス	1,600	1,016.00	1,625,600
アウトソーシング	79,000	948.00	74,892,000
ウェルネット	11,800	613.00	7,233,400
ワールドホールディングス	5,900	2,463.00	14,531,700
ディー・エヌ・エー	56,500	1,764.00	99,666,000
博報堂D Yホールディングス	169,300	1,342.00	227,200,600
ぐるなび	24,300	382.00	9,282,600
タカミヤ	18,000	362.00	6,516,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,100	832.00	6,739,200
ファンコミュニケーションズ	26,000	407.00	10,582,000
ライク	4,900	2,060.00	10,094,000
ビジネス・ブレークスルー	5,000	376.00	1,880,000
エスプール	38,100	638.00	24,307,800
WDBホールディングス	6,700	2,117.00	14,183,900

手間いらず	2,000	5,020.00	10,040,000
ティア	8,000	417.00	3,336,000
CDG	1,500	1,047.00	1,570,500
アドウェイズ	18,200	498.00	9,063,600
バリューコマース	10,000	1,868.00	18,680,000
インフォマート	137,800	366.00	50,434,800
サッポロホールディングス	41,900	3,130.00	131,147,000
アサヒグループホールディングス	293,900	4,089.00	1,201,757,100
キリンホールディングス	574,000	1,939.50	1,113,273,000
宝ホールディングス	86,800	1,010.00	87,668,000
オエノンホールディングス	38,000	244.00	9,272,000
養命酒製造	4,300	1,787.00	7,684,100
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	99,600	1,349.00	134,360,400
サントリー食品インターナショナル	89,500	4,360.00	390,220,000
ダイドーグループホールディングス	7,200	4,625.00	33,300,000
伊藤園	47,300	4,380.00	207,174,000
キーコーヒー	14,200	2,058.00	29,223,600
ユニカフェ	4,400	901.00	3,964,400
ジャパンフーズ	1,500	1,072.00	1,608,000
日清オイリオグループ	17,900	3,095.00	55,400,500
不二製油グループ本社	29,600	1,971.00	58,341,600
かどや製油	1,200	3,485.00	4,182,000
J-オイルミルズ	12,900	1,494.00	19,272,600
ローソン	33,800	5,000.00	169,000,000
サンエー	10,500	4,030.00	42,315,000
カワチ薬品	10,700	2,218.00	23,732,600
エービーシー・マート	19,800	7,140.00	141,372,000
ハードオフコーポレーション	5,400	1,298.00	7,009,200
高千穂交易	4,800	2,214.00	10,627,200
アスクル	32,900	1,669.00	54,910,100
ゲオホールディングス	14,300	1,987.00	28,414,100
アダストリア	16,500	2,227.00	36,745,500
ジーフット	7,100	293.00	2,080,300
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,800	405.00	729,000
オルバヘルスケアホールディングス	2,100	1,558.00	3,271,800
伊藤忠食品	2,600	4,825.00	12,545,000
くら寿司	16,000	3,120.00	49,920,000
キャンドウ	4,800	2,218.00	10,646,400
エレマテック	12,200	1,560.00	19,032,000
I Kホールディングス	4,500	390.00	1,755,000
パルグループホールディングス	13,300	2,524.00	33,569,200
エディオン	54,000	1,260.00	68,040,000
あらた	10,500	4,030.00	42,315,000
サーラコーポレーション	28,700	715.00	20,520,500
ワッツ	6,600	711.00	4,692,600
トーマンデバイス	1,800	5,650.00	10,170,000
ハローズ	6,100	3,055.00	18,635,500
J Pホールディングス	38,100	322.00	12,268,200
フジオフードグループ本社	11,400	1,384.00	15,777,600

あみやき亭	3,300	2,871.00	9,474,300
東京エレクトロン デバイス	5,000	7,010.00	35,050,000
ひらまつ	29,200	188.00	5,489,600
円谷フィールズホールディングス	11,700	2,397.00	28,044,900
双日	145,100	2,469.00	358,251,900
アルフレッサ ホールディングス	137,100	1,591.00	218,126,100
大黒天物産	4,800	5,150.00	24,720,000
ハニーズホールディングス	12,100	1,452.00	17,569,200
ファーマライズホールディングス	3,000	612.00	1,836,000
キッコーマン	84,200	6,790.00	571,718,000
味の素	311,300	3,917.00	1,219,362,100
ブルドックソース	5,000	1,809.00	9,045,000
キューピー	68,400	2,163.00	147,949,200
ハウス食品グループ本社	38,900	2,642.00	102,773,800
カゴメ	59,300	2,913.00	172,740,900
焼津水産化学工業	5,700	822.00	4,685,400
アリアケジャパン	11,100	4,330.00	48,063,000
ピエトロ	1,600	1,803.00	2,884,800
エバラ食品工業	3,200	3,005.00	9,616,000
やまみ	1,100	1,379.00	1,516,900
ニチレイ	58,400	2,693.00	157,271,200
横浜冷凍	37,200	1,064.00	39,580,800
東洋水産	64,300	4,910.00	315,713,000
イートアンドホールディングス	5,300	2,246.00	11,903,800
大冷	1,600	1,885.00	3,016,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	645.00	5,160,000
日清食品ホールディングス	44,700	10,230.00	457,281,000
永谷園ホールディングス	6,200	2,003.00	12,418,600
一正蒲鉾	5,400	716.00	3,866,400
フジッコ	13,000	1,862.00	24,206,000
ロック・フィールド	15,600	1,482.00	23,119,200
日本たばこ産業	837,600	2,584.00	2,164,358,400
ケンコーマヨネーズ	8,600	1,328.00	11,420,800
わらべや日洋ホールディングス	9,400	1,973.00	18,546,200
なとり	8,000	2,044.00	16,352,000
イフジ産業	2,100	918.00	1,927,800
ファーマフーズ	19,500	1,249.00	24,355,500
北の達人コーポレーション	54,500	302.00	16,459,000
ユーグレナ	81,900	954.00	78,132,600
紀文食品	9,900	939.00	9,296,100
ピックルスホールディングス	7,400	1,125.00	8,325,000
スター・マイカ・ホールディングス	11,500	725.00	8,337,500
SREホールディングス	6,100	3,590.00	21,899,000
ADワークスグループ	31,700	143.00	4,533,100
片倉工業	11,800	1,689.00	19,930,200
グンゼ	9,700	4,125.00	40,012,500
ヒューリック	296,800	1,036.00	307,484,800
神栄	1,700	786.00	1,336,200
ラサ商事	6,200	1,166.00	7,229,200
アルペン	11,200	1,955.00	21,896,000

ハブ	4,500	620.00	2,790,000
ラクーンホールディングス	12,800	1,102.00	14,105,600
クオールホールディングス	18,700	1,142.00	21,355,400
アルコニックス	17,900	1,325.00	23,717,500
神戸物産	105,700	3,665.00	387,390,500
ソリトンシステムズ	6,600	1,090.00	7,194,000
ジンズホールディングス	8,000	4,000.00	32,000,000
ビックカメラ	90,800	1,196.00	108,596,800
DCMホールディングス	83,400	1,171.00	97,661,400
ペッパーフードサービス	28,500	175.00	4,987,500
ハイパー	2,100	443.00	930,300
MonotaRO	193,700	1,911.00	370,160,700
東京一番フーズ	3,200	477.00	1,526,400
DDホールディングス	8,600	695.00	5,977,000
あいホールディングス	21,900	2,106.00	46,121,400
ディーブイエックス	3,900	1,048.00	4,087,200
きちりホールディングス	3,800	572.00	2,173,600
アークランドサービスホールディングス	11,200	2,152.00	24,102,400
J. フロントリテイリング	169,900	1,130.00	191,987,000
ドトール・日レスホールディングス	24,200	1,672.00	40,462,400
マツキヨココカラ&カンパニー	82,900	6,460.00	535,534,000
ブロンコビリー	7,300	2,418.00	17,651,400
ZOZO	90,300	3,225.00	291,217,500
トレジャー・ファクトリー	4,100	2,484.00	10,184,400
物語コーポレーション	7,600	6,460.00	49,096,000
三越伊勢丹ホールディングス	230,100	1,335.00	307,183,500
東洋紡	55,800	996.00	55,576,800
ユニチカ	39,000	241.00	9,399,000
富士紡ホールディングス	5,000	3,190.00	15,950,000
日清紡ホールディングス	106,100	955.00	101,325,500
倉敷紡績	9,700	2,113.00	20,496,100
ダイワボウホールディングス	55,800	1,918.00	107,024,400
シキボウ	7,200	952.00	6,854,400
日東紡績	15,400	1,929.00	29,706,600
トヨタ紡織	54,300	1,800.00	97,740,000
マクニカホールディングス	33,500	3,255.00	109,042,500
Hamee	5,400	712.00	3,844,800
マーケットエンタープライズ	1,300	967.00	1,257,100
ラクト・ジャパン	5,200	2,184.00	11,356,800
ウエルシアホールディングス	70,900	3,045.00	215,890,500
クリエイトSDホールディングス	22,600	3,210.00	72,546,000
グリムス	5,600	2,173.00	12,168,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,800	815.00	16,137,000
八洲電機	11,100	1,058.00	11,743,800
メディアスホールディングス	8,600	688.00	5,916,800
レスターホールディングス	13,000	2,049.00	26,637,000
ジューテックホールディングス	2,600	1,177.00	3,060,200
丸善CHIホールディングス	16,300	329.00	5,362,700

大光	5,900	659.00	3,888,100
OCHIホールディングス	3,200	1,239.00	3,964,800
TOKAIホールディングス	67,400	842.00	56,750,800
黒谷	3,900	600.00	2,340,000
ミサワ	2,300	648.00	1,490,400
ティーライフ	1,600	1,293.00	2,068,800
Cominix	2,300	732.00	1,683,600
エー・ピーホールディングス	1,800	455.00	819,000
三洋貿易	14,000	1,093.00	15,302,000
チムニー	4,300	1,121.00	4,820,300
シュッピン	10,100	1,229.00	12,412,900
ビューティガレージ	2,300	3,490.00	8,027,000
オイシックス・ラ・大地	18,300	2,420.00	44,286,000
ウイン・パートナーズ	10,000	991.00	9,910,000
ネクステージ	31,100	2,576.00	80,113,600
ジョイフル本田	43,800	1,909.00	83,614,200
鳥貴族ホールディングス	5,000	2,078.00	10,390,000
ホットランド	10,500	1,454.00	15,267,000
すかいらーくホールディングス	186,800	1,537.00	287,111,600
SFPホールディングス	7,500	1,797.00	13,477,500
綿半ホールディングス	10,700	1,327.00	14,198,900
日本毛織	34,100	941.00	32,088,100
ダイトウボウ	21,500	81.00	1,741,500
トーア紡コーポレーション	4,100	342.00	1,402,200
ダイドーリミテッド	19,700	270.00	5,319,000
ヨシックスホールディングス	2,500	2,157.00	5,392,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,600	1,110.00	49,506,000
三栄建築設計	6,100	1,474.00	8,991,400
野村不動産ホールディングス	79,400	2,837.00	225,257,800
三重交通グループホールディングス	27,300	477.00	13,022,100
サムティ	20,100	2,125.00	42,712,500
ディア・ライフ	19,100	602.00	11,498,200
コーセーアールイー	4,200	814.00	3,418,800
地主	9,700	1,798.00	17,440,600
プレサンスコーポレーション	16,700	1,531.00	25,567,700
フィル・カンパニー	2,100	992.00	2,083,200
THEグローバル社	7,500	210.00	1,575,000
ハウスコム	1,900	1,096.00	2,082,400
JPMC	6,400	998.00	6,387,200
サンセイランディック	3,900	821.00	3,201,900
エストラスト	1,500	580.00	870,000
フージャースホールディングス	19,500	749.00	14,605,500
オープンハウスグループ	46,600	5,050.00	235,330,000
東急不動産ホールディングス	382,500	637.00	243,652,500
飯田グループホールディングス	111,300	2,044.00	227,497,200
イーグランド	1,800	1,474.00	2,653,200
ムゲンエステート	8,400	477.00	4,006,800
帝国繊維	14,500	1,523.00	22,083,500
日本コークス工業	116,900	88.00	10,287,200

ゴルフダイジェスト・オンライン	6,100	1,505.00	9,180,500
ミタチ産業	3,600	1,035.00	3,726,000
BEENOS	7,700	2,027.00	15,607,900
あさひ	11,400	1,347.00	15,355,800
日本調剤	9,300	1,152.00	10,713,600
コスモス薬品	15,500	13,410.00	207,855,000
シップヘルスケアホールディングス	49,100	2,566.00	125,990,600
トーエル	6,000	755.00	4,530,000
ソフトクリエイトホールディングス	5,300	3,225.00	17,092,500
セブン&アイ・ホールディングス	471,100	5,749.00	2,708,353,900
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	102,800	931.00	95,706,800
明治電機工業	5,000	1,060.00	5,300,000
ツルハホールディングス	33,500	9,660.00	323,610,000
デリカフーズホールディングス	5,500	505.00	2,777,500
スターティアホールディングス	2,500	950.00	2,375,000
サンマルクホールディングス	11,100	1,691.00	18,770,100
フェリシモ	3,100	1,003.00	3,109,300
トリドールホールディングス	33,900	2,701.00	91,563,900
帝人	124,200	1,276.00	158,479,200
東レ	867,000	742.10	643,400,700
クラレ	205,800	1,038.00	213,620,400
旭化成	808,200	933.50	754,454,700
TOKYO BASE	14,000	297.00	4,158,000
稲葉製作所	7,800	1,385.00	10,803,000
宮地エンジニアリンググループ	3,800	3,525.00	13,395,000
トーカロ	36,600	1,168.00	42,748,800
アルファ	4,900	924.00	4,527,600
SUMCO	253,700	1,869.00	474,165,300
川田テクノロジーズ	3,200	3,300.00	10,560,000
RS Technologies	8,800	3,750.00	33,000,000
ジェイテックコーポレーション	1,600	3,085.00	4,936,000
信和	7,300	790.00	5,767,000
ビーロッド	8,500	533.00	4,530,500
ファーストブラザーズ	2,400	894.00	2,145,600
And Doホールディングス	7,500	800.00	6,000,000
シーアールイー	5,700	1,125.00	6,412,500
プロパティエージェント	1,500	1,173.00	1,759,500
ケイアイスター不動産	6,000	4,850.00	29,100,000
アグレ都市デザイン	2,100	1,569.00	3,294,900
グッドコムアセット	11,700	784.00	9,172,800
ジェイ・エス・ビー	3,100	4,250.00	13,175,000
ロードスターキャピタル	5,400	1,640.00	8,856,000
テンポイノベーション	4,000	1,065.00	4,260,000
グローバル・リンク・マネジメント	2,300	1,104.00	2,539,200
フェイスネットワーク	1,600	1,386.00	2,217,600
住江織物	2,200	1,838.00	4,043,600
日本フェルト	7,300	400.00	2,920,000
イチカワ	1,500	1,309.00	1,963,500
エコナックホールディングス	23,000	87.00	2,001,000

日東製網	1,500	1,403.00	2,104,500
芦森工業	2,200	1,277.00	2,809,400
アツギ	7,400	397.00	2,937,800
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,106.00	2,654,400
JMホールディングス	11,500	1,659.00	19,078,500
コメダホールディングス	33,500	2,412.00	80,802,000
サツドラホールディングス	6,100	757.00	4,617,700
アレンザホールディングス	10,300	1,007.00	10,372,100
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,711.00	6,330,700
バロックジャパンリミテッド	8,800	840.00	7,392,000
クスリのアオキホールディングス	13,700	7,600.00	104,120,000
ダイニック	3,300	616.00	2,032,800
共和レザー	7,500	498.00	3,735,000
ピーバンドットコム	1,600	513.00	820,800
力の源ホールディングス	7,500	1,016.00	7,620,000
FOOD & LIFE COMPANIES	78,500	2,923.00	229,455,500
アセンテック	4,600	449.00	2,065,400
セーレン	24,900	2,357.00	58,689,300
ソトー	4,200	814.00	3,418,800
東海染工	1,300	1,121.00	1,457,300
小松マテーレ	18,700	764.00	14,286,800
ワコールホールディングス	24,800	2,371.00	58,800,800
ホギメディカル	17,400	3,350.00	58,290,000
クラウドディアホールディングス	3,000	395.00	1,185,000
T S I ホールディングス	46,300	430.00	19,909,000
マツオカコーポレーション	3,600	1,068.00	3,844,800
ワールド	16,600	1,296.00	21,513,600
T I S	145,600	3,515.00	511,784,000
J N S ホールディングス	5,700	314.00	1,789,800
グリー	69,400	709.00	49,204,600
GMOベパボ	1,700	1,951.00	3,316,700
コーエーテクモホールディングス	81,100	2,345.00	190,179,500
三菱総合研究所	6,300	4,745.00	29,893,500
ボルテージ	3,800	316.00	1,200,800
電算	800	1,531.00	1,224,800
AGS	5,400	686.00	3,704,400
ファインデックス	10,400	514.00	5,345,600
ブレインパッド	12,800	763.00	9,766,400
K L a b	25,400	458.00	11,633,200
ポールトゥウィンホールディングス	22,100	842.00	18,608,200
ネクソン	334,800	3,035.00	1,016,118,000
アイスタイル	41,400	513.00	21,238,200
エムアップホールディングス	15,900	1,378.00	21,910,200
エイチーム	9,600	719.00	6,902,400
エニグモ	16,400	641.00	10,512,400
テクノスジャパン	10,700	469.00	5,018,300
e n i s h	9,700	364.00	3,530,800
コロプラ	50,200	633.00	31,776,600
オルトプラス	9,800	203.00	1,989,400

ブロードリーフ	75,600	438.00	33,112,800
クロス・マーケティンググループ	5,100	760.00	3,876,000
デジタルハーツホールディングス	8,000	1,785.00	14,280,000
システム情報	11,400	835.00	9,519,000
メディアドゥ	5,200	1,714.00	8,912,800
じげん	37,600	376.00	14,137,600
ブイキューブ	15,500	747.00	11,578,500
エンカレッジ・テクノロジー	3,100	493.00	1,528,300
サイバーリンクス	4,200	981.00	4,120,200
ディー・エル・イー	9,300	260.00	2,418,000
フィックスターズ	14,500	1,203.00	17,443,500
CARTA HOLDINGS	6,100	1,604.00	9,784,400
オブティム	10,700	1,053.00	11,267,100
セレス	5,100	976.00	4,977,600
SHIFT	9,500	24,650.00	234,175,000
特種東海製紙	6,400	2,797.00	17,900,800
ティーガイア	13,400	1,608.00	21,547,200
セック	1,600	2,742.00	4,387,200
テクマトリックス	23,600	1,779.00	41,984,400
プロシップ	5,600	1,480.00	8,288,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,700	2,126.00	84,402,200
GMOペイメントゲートウェイ	29,600	11,420.00	338,032,000
ザッパラス	4,800	371.00	1,780,800
システムリサーチ	4,100	2,151.00	8,819,100
インターネットイニシアティブ	72,300	2,380.00	172,074,000
さくらインターネット	14,500	490.00	7,105,000
ヴィンクス	3,900	1,477.00	5,760,300
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,000	4,135.00	16,540,000
SRAホールディングス	6,500	2,982.00	19,383,000
システムインテグレータ	4,000	433.00	1,732,000
朝日ネット	13,900	581.00	8,075,900
eBASE	18,100	572.00	10,353,200
アバントグループ	16,300	1,368.00	22,298,400
アドソル日進	5,400	1,327.00	7,165,800
ODKソリューションズ	2,700	601.00	1,622,700
フリービット	7,900	997.00	7,876,300
コムチュア	17,200	2,356.00	40,523,200
サイバーコム	1,900	1,485.00	2,821,500
アステリア	10,100	768.00	7,756,800
アイル	7,200	1,766.00	12,715,200
王子ホールディングス	539,200	517.00	278,766,400
日本製紙	67,200	927.00	62,294,400
三菱製紙	15,600	280.00	4,368,000
北越コーポレーション	81,800	785.00	64,213,000
中越パルプ工業	5,100	987.00	5,033,700
巴川製紙所	4,100	676.00	2,771,600
大王製紙	57,100	974.00	55,615,400
阿波製紙	3,200	371.00	1,187,200

マークライNZ	7,000	2,551.00	17,857,000
メディカル・データ・ビジョN	19,200	905.00	17,376,000
g u m i	21,100	976.00	20,593,600
ショークェース	3,100	310.00	961,000
モバイルファクトリー	2,500	902.00	2,255,000
テラスカイ	5,500	2,347.00	12,908,500
デジタル・インフォメーション・テク ノロジー	6,600	1,783.00	11,767,800
P C Iホールディングス	5,300	1,029.00	5,453,700
アイビーシー	1,800	400.00	720,000
ネオジャパン	4,400	1,018.00	4,479,200
P R T I M E S	3,300	2,458.00	8,111,400
ラクス	61,100	1,659.00	101,364,900
ランドコンピュータ	3,200	925.00	2,960,000
ダブルスタンダード	5,200	2,275.00	11,830,000
オープンドア	9,100	1,778.00	16,179,800
マイネット	4,200	370.00	1,554,000
アカツキ	6,000	2,217.00	13,302,000
ベネフィットジャパン	800	1,207.00	965,600
U b i c o mホールディングス	4,100	2,185.00	8,958,500
カナミックネットワーク	18,600	540.00	10,044,000
ノムラシステムコーポレーション	12,300	114.00	1,402,200
レンゴー	117,700	882.00	103,811,400
トーモク	7,500	1,620.00	12,150,000
ザ・パツク	9,600	2,436.00	23,385,600
チェンジ	31,600	2,100.00	66,360,000
シンクロ・フールド	8,000	457.00	3,656,000
オークネット	6,600	1,783.00	11,767,800
キャピタル・アセット・プランニング	2,400	572.00	1,372,800
セグエグループ	3,600	829.00	2,984,400
エイトレッド	1,800	1,430.00	2,574,000
マクロミル	29,300	1,108.00	32,464,400
ビーグリー	2,000	1,166.00	2,332,000
オロ	4,000	1,950.00	7,800,000
ユーザーローカル	4,700	1,308.00	6,147,600
テモナ	2,400	263.00	631,200
ニーズウェル	4,100	751.00	3,079,100
マネーフォワード	31,100	4,370.00	135,907,000
サインポスト	4,900	645.00	3,160,500
レゾナック・ホールディングス	125,000	2,120.00	265,000,000
住友化学	960,100	473.00	454,127,300
住友精化	5,300	4,005.00	21,226,500
日産化学	61,400	5,890.00	361,646,000
ラサ工業	4,900	1,901.00	9,314,900
クレハ	11,100	8,290.00	92,019,000
多木化学	5,000	4,485.00	22,425,000
テイカ	8,500	1,168.00	9,928,000
石原産業	23,400	1,061.00	24,827,400
片倉コープアグリ	2,500	1,594.00	3,985,000
日本曹達	13,900	4,120.00	57,268,000

東ソー	172,600	1,584.00	273,398,400
トクヤマ	41,800	1,783.00	74,529,400
セントラル硝子	20,800	2,770.00	57,616,000
東亜合成	66,400	1,116.00	74,102,400
大阪ソーダ	7,700	3,940.00	30,338,000
関東電化工業	24,900	933.00	23,231,700
デンカ	47,000	3,030.00	142,410,000
イビデン	74,900	5,170.00	387,233,000
信越化学工業	218,400	16,650.00	3,636,360,000
日本カーバイド工業	4,900	1,290.00	6,321,000
電算システムホールディングス	6,200	2,129.00	13,199,800
堺化学工業	9,800	1,771.00	17,355,800
第一稀元素化学工業	11,700	1,042.00	12,191,400
エア・ウォーター	122,000	1,540.00	187,880,000
日本酸素ホールディングス	125,500	2,024.00	254,012,000
日本化学工業	4,400	1,706.00	7,506,400
東邦アセチレン	2,600	1,131.00	2,940,600
日本パーカライジング	64,100	923.00	59,164,300
高压ガス工業	18,800	657.00	12,351,600
チタン工業	1,500	1,470.00	2,205,000
四国化成ホールディングス	15,400	1,299.00	20,004,600
戸田工業	2,700	2,515.00	6,790,500
ステラ ケミファ	7,600	2,517.00	19,129,200
保土谷化学工業	3,700	2,853.00	10,556,100
日本触媒	19,600	5,280.00	103,488,000
大日精化工業	8,900	1,686.00	15,005,400
カネカ	29,500	3,275.00	96,612,500
協和キリン	156,600	2,941.00	460,560,600
三菱瓦斯化学	96,600	1,824.00	176,198,400
三井化学	108,700	3,040.00	330,448,000
J S R	120,700	2,796.00	337,477,200
東京応化工業	22,600	6,250.00	141,250,000
大阪有機化学工業	9,700	1,999.00	19,390,300
三菱ケミカルグループ	873,200	686.80	599,713,760
KHネオケム	21,500	2,712.00	58,308,000
ダイセル	190,100	946.00	179,834,600
住友ベークライト	19,100	3,985.00	76,113,500
積水化学工業	264,600	1,869.00	494,537,400
日本ゼオン	77,600	1,343.00	104,216,800
アイカ工業	32,600	2,988.00	97,408,800
UBE	66,600	1,932.00	128,671,200
積水樹脂	18,800	1,827.00	34,347,600
タキロンシーアイ	28,400	512.00	14,540,800
旭有機材	8,400	2,760.00	23,184,000
ニチバン	8,000	1,833.00	14,664,000
リケンテクノス	27,900	481.00	13,419,900
大倉工業	5,900	1,810.00	10,679,000
積水化成成品工業	18,100	380.00	6,878,000
群栄化学工業	2,600	2,367.00	6,154,200
タイガースポリマー	6,000	400.00	2,400,000

ミライアル	4,000	1,459.00	5,836,000
ダイキアクシス	4,800	655.00	3,144,000
ダイキョーニシカワ	28,500	552.00	15,732,000
竹本容器	4,500	733.00	3,298,500
森六ホールディングス	6,500	1,716.00	11,154,000
恵和	8,600	1,574.00	13,536,400
日本化薬	98,800	1,138.00	112,434,400
カーリットホールディングス	11,600	766.00	8,885,600
ソルクシーズ	10,600	352.00	3,731,200
C Lホールディングス	3,800	786.00	2,986,800
プレステージ・インターナショナル	55,800	688.00	38,390,400
フェイス	3,800	510.00	1,938,000
プロトコーポレーション	16,200	1,178.00	19,083,600
ハイマックス	4,100	1,438.00	5,895,800
アミューズ	7,200	1,705.00	12,276,000
野村総合研究所	265,800	3,170.00	842,586,000
ドリームインキュベータ	4,100	2,505.00	10,270,500
サイバネットシステム	10,900	985.00	10,736,500
クイック	10,100	2,068.00	20,886,800
T A C	6,600	202.00	1,333,200
C Eホールディングス	6,600	501.00	3,306,600
日本システム技術	5,300	1,647.00	8,729,100
電通グループ	130,500	4,170.00	544,185,000
インテージホールディングス	17,600	1,390.00	24,464,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,446.00	6,651,600
東邦システムサイエンス	3,800	1,002.00	3,807,600
ぴあ	4,500	3,100.00	13,950,000
イオンファンタジー	5,700	2,760.00	15,732,000
ソースネクスト	65,900	304.00	20,033,600
シーティーエス	14,700	785.00	11,539,500
ネクシイズグループ	4,200	644.00	2,704,800
インフォコム	16,700	2,096.00	35,003,200
メディカルシステムネットワーク	11,800	414.00	4,885,200
日本精化	7,300	2,257.00	16,476,100
扶桑化学工業	11,900	3,500.00	41,650,000
トリケミカル研究所	17,300	2,156.00	37,298,800
シンプレクス・ホールディングス	21,700	2,144.00	46,524,800
HEROZ	4,400	995.00	4,378,000
ラクスル	18,200	3,350.00	60,970,000
メルカリ	58,300	2,792.00	162,773,600
I P S	4,300	2,738.00	11,773,400
F I G	14,900	384.00	5,721,600
システムサポート	5,500	1,411.00	7,760,500
A D E K A	45,100	2,162.00	97,506,200
日油	40,100	5,210.00	208,921,000
ミヨシ油脂	4,600	915.00	4,209,000
新日本理化	17,800	245.00	4,361,000
ハリマ化成グループ	9,100	810.00	7,371,000
イーソル	8,100	779.00	6,309,900
アルテリア・ネットワークス	12,000	1,243.00	14,916,000

東海ソフト	2,000	931.00	1,862,000
ウイングアーク1st	13,200	2,071.00	27,337,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,600	1,480.00	5,328,000
サーバーワークス	2,400	2,480.00	5,952,000
東名	900	1,696.00	1,526,400
ヴィッツ	1,200	933.00	1,119,600
トピラシシステムズ	3,200	816.00	2,611,200
Sansan	48,300	1,303.00	62,934,900
Link-U	2,300	976.00	2,244,800
ギフトィ	13,900	1,807.00	25,117,300
花王	315,100	5,103.00	1,607,955,300
第一工業製薬	4,700	1,962.00	9,221,400
石原ケミカル	5,800	1,221.00	7,081,800
日華化学	5,200	809.00	4,206,800
ニイタカ	2,400	1,962.00	4,708,800
三洋化成工業	7,900	4,020.00	31,758,000
メドレー	13,000	4,080.00	53,040,000
ベース	4,500	3,670.00	16,515,000
JMDC	21,300	3,965.00	84,454,500
武田薬品工業	1,146,600	4,099.00	4,699,913,400
アステラス製薬	1,241,700	1,914.50	2,377,234,650
住友ファーマ	96,100	904.00	86,874,400
塩野義製薬	165,600	6,295.00	1,042,452,000
わかもと製薬	12,000	218.00	2,616,000
日本新薬	30,500	7,070.00	215,635,000
中外製薬	405,700	3,301.00	1,339,215,700
科研製薬	22,200	3,660.00	81,252,000
エーザイ	157,600	8,329.00	1,312,650,400
理研ビタミン	11,100	1,839.00	20,412,900
ロート製薬	125,400	2,183.00	273,748,200
小野薬品工業	249,900	2,904.00	725,709,600
久光製薬	28,800	3,665.00	105,552,000
有機合成薬品工業	9,700	290.00	2,813,000
持田製薬	15,500	3,250.00	50,375,000
参天製薬	243,700	1,041.00	253,691,700
扶桑薬品工業	4,200	1,965.00	8,253,000
日本ケミファ	1,300	1,681.00	2,185,300
ツムラ	40,700	2,707.00	110,174,900
テルモ	403,600	3,651.00	1,473,543,600
H. U. グループホールディングス	38,800	2,810.00	109,028,000
キッセイ薬品工業	19,900	2,459.00	48,934,100
生化学工業	24,600	829.00	20,393,400
栄研化学	21,000	1,643.00	34,503,000
鳥居薬品	6,900	2,879.00	19,865,100
JCRファーマ	43,700	1,535.00	67,079,500
東和薬品	19,800	2,014.00	39,877,200
富士製薬工業	8,200	1,022.00	8,380,400
ゼリア新薬工業	17,900	2,094.00	37,482,600
第一三共	1,128,700	3,952.00	4,460,622,400

キョーリン製薬ホールディングス	28,100	1,657.00	46,561,700
大幸薬品	23,400	373.00	8,728,200
ダイト	9,700	2,428.00	23,551,600
大塚ホールディングス	296,500	4,087.00	1,211,795,500
大正製薬ホールディングス	28,800	5,320.00	153,216,000
ペプチドリーム	62,700	2,050.00	128,535,000
大日本塗料	15,900	766.00	12,179,400
日本ペイントホールディングス	572,600	1,152.00	659,635,200
関西ペイント	118,400	1,633.00	193,347,200
神東塗料	11,400	130.00	1,482,000
中国塗料	24,000	966.00	23,184,000
日本特殊塗料	8,100	860.00	6,966,000
藤倉化成	17,600	422.00	7,427,200
太陽ホールディングス	19,600	2,272.00	44,531,200
D I C	50,500	2,345.00	118,422,500
サカタインクス	28,800	1,030.00	29,664,000
東洋インキＳＣホールディングス	25,300	1,787.00	45,211,100
T&K TOKA	11,400	1,264.00	14,409,600
アルプス技研	11,500	2,064.00	23,736,000
サニックス	21,300	209.00	4,451,700
日本空調サービス	14,300	685.00	9,795,500
オリエンタルランド	140,500	19,085.00	2,681,442,500
フォーカスシステムズ	9,500	1,009.00	9,585,500
ダスキン	29,500	2,950.00	87,025,000
パーク２４	99,100	2,121.00	210,191,100
明光ネットワークジャパン	17,500	605.00	10,587,500
ファルコホールディングス	5,900	1,707.00	10,071,300
クレスコ	10,000	1,709.00	17,090,000
フジ・メディア・ホールディングス	124,300	1,052.00	130,763,600
秀英予備校	3,000	432.00	1,296,000
田谷	1,600	532.00	851,200
ラウンドワン	111,000	489.00	54,279,000
リゾートトラスト	52,500	2,292.00	120,330,000
オービック	43,200	19,730.00	852,336,000
ジャストシステム	18,500	2,940.00	54,390,000
TDCソフト	11,000	1,450.00	15,950,000
Zホールディングス	1,843,900	341.00	628,769,900
ビー・エム・エル	16,400	3,250.00	53,300,000
トレンドマイクロ	74,900	6,110.00	457,639,000
りらいあコミュニケーションズ	21,900	969.00	21,221,100
IDホールディングス	8,600	908.00	7,808,800
リソー教育	60,300	350.00	21,105,000
日本オラクル	24,700	8,410.00	207,727,000
早稲田アカデミー	7,400	1,131.00	8,369,400
アルファシステムズ	4,200	3,905.00	16,401,000
フューチャー	32,100	1,587.00	50,942,700
CAC Holdings	8,000	1,415.00	11,320,000
SBテクノロジー	5,400	1,873.00	10,114,200
トーセ	3,500	766.00	2,681,000
ユー・エス・エス	136,600	2,017.00	275,522,200

オービックビジネスコンサルタント	25,400	4,280.00	108,712,000
伊藤忠テクノソリューションズ	69,500	3,055.00	212,322,500
アイティフォー	17,100	828.00	14,158,800
東京個別指導学院	15,800	514.00	8,121,200
東計電算	1,600	5,150.00	8,240,000
サイバーエージェント	317,700	1,188.00	377,427,600
楽天グループ	614,100	618.00	379,513,800
エックスネット	1,700	998.00	1,696,600
クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,970.00	15,169,000
モーニングスター	21,700	460.00	9,982,000
テー・オー・ダブリュー	28,500	286.00	8,151,000
大塚商会	73,300	4,180.00	306,394,000
サイボウズ	17,800	2,377.00	42,310,600
山田コンサルティンググループ	6,600	1,153.00	7,609,800
セントラルスポーツ	5,000	2,390.00	11,950,000
パラカ	4,600	1,863.00	8,569,800
電通国際情報サービス	15,800	3,980.00	62,884,000
ACCESS	15,400	882.00	13,582,800
デジタルガレージ	23,000	4,300.00	98,900,000
イーエムシステムズ	21,600	864.00	18,662,400
ウェザーニューズ	4,600	6,890.00	31,694,000
C I J	11,800	879.00	10,372,200
ビジネスエンジニアリング	2,600	2,375.00	6,175,000
日本エンタープライズ	13,700	124.00	1,698,800
WOWOW	7,300	1,261.00	9,205,300
スカラ	12,700	710.00	9,017,000
インテリジェント ウェイブ	6,900	735.00	5,071,500
フルキャストホールディングス	12,600	2,690.00	33,894,000
エン・ジャパン	24,100	2,322.00	55,960,200
あすか製薬ホールディングス	13,200	1,288.00	17,001,600
サワイグループホールディングス	29,600	3,925.00	116,180,000
富士フイルムホールディングス	248,700	6,718.00	1,670,766,600
コニカミノルタ	291,300	519.00	151,184,700
資生堂	270,500	6,548.00	1,771,234,000
ライオン	155,500	1,439.00	223,764,500
高砂香料工業	8,600	2,518.00	21,654,800
マンダム	28,000	1,391.00	38,948,000
ミルボン	19,100	5,610.00	107,151,000
ファンケル	56,600	2,605.00	147,443,000
コーセー	26,200	13,510.00	353,962,000
コタ	10,900	1,666.00	18,159,400
シーボン	1,500	1,562.00	2,343,000
ポーラ・オルビスホールディングス	66,300	1,781.00	118,080,300
ノエビアホールディングス	11,500	5,420.00	62,330,000
アジュバンホールディングス	3,200	965.00	3,088,000
新日本製薬	7,400	1,372.00	10,152,800
エステー	10,000	1,500.00	15,000,000
アグロ カネショウ	4,800	1,553.00	7,454,400
コニシ	21,700	1,727.00	37,475,900
長谷川香料	26,800	2,836.00	76,004,800

星光PMC	6,500	531.00	3,451,500
小林製薬	37,700	8,630.00	325,351,000
荒川化学工業	11,100	946.00	10,500,600
メック	10,700	2,305.00	24,663,500
日本高純度化学	3,500	2,384.00	8,344,000
タカラバイオ	34,900	1,705.00	59,504,500
JCU	14,500	3,190.00	46,255,000
新田ゼラチン	7,900	841.00	6,643,900
OATアグリオ	5,200	1,467.00	7,628,400
デクセリアルズ	37,200	2,661.00	98,989,200
アース製薬	11,700	4,855.00	56,803,500
北興化学工業	12,900	804.00	10,371,600
大成ラミック	4,200	2,959.00	12,427,800
クミアイ化学工業	51,500	847.00	43,620,500
日本農薬	23,700	703.00	16,661,100
富士興産	3,100	1,194.00	3,701,400
ニチレキ	15,400	1,294.00	19,927,600
ユシロ化学工業	6,600	773.00	5,101,800
ビービー・カストロール	5,000	863.00	4,315,000
富士石油	26,300	256.00	6,732,800
MORESCO	4,300	1,178.00	5,065,400
出光興産	143,800	3,015.00	433,557,000
ENEOSホールディングス	2,340,900	453.40	1,061,364,060
コスモエネルギーホールディングス	51,200	3,600.00	184,320,000
テスホールディングス	13,500	1,101.00	14,863,500
インフロニア・ホールディングス	132,800	1,009.00	133,995,200
横浜ゴム	73,600	2,020.00	148,672,000
TOYO TIRE	74,400	1,492.00	111,004,800
ブリヂストン	413,700	4,748.00	1,964,247,600
住友ゴム工業	127,100	1,115.00	141,716,500
藤倉コンポジット	9,200	830.00	7,636,000
オカモト	7,200	3,680.00	26,496,000
WOW WORLD GROUP	2,100	1,096.00	2,301,600
アキレス	8,300	1,240.00	10,292,000
フコク	6,700	1,024.00	6,860,800
ニッタ	13,100	2,796.00	36,627,600
クリエートメディック	4,400	869.00	3,823,600
住友理工	25,100	618.00	15,511,800
三ツ星ベルト	18,800	3,485.00	65,518,000
バンドー化学	20,500	950.00	19,475,000
AGC	131,800	4,545.00	599,031,000
日本板硝子	66,000	649.00	42,834,000
石塚硝子	1,900	1,435.00	2,726,500
有沢製作所	21,100	1,301.00	27,451,100
日本山村硝子	4,800	526.00	2,524,800
日本電気硝子	52,900	2,397.00	126,801,300
オハラ	6,100	1,126.00	6,868,600
住友大阪セメント	18,200	3,130.00	56,966,000
太平洋セメント	82,500	2,023.00	166,897,500
リソルホールディングス	1,200	4,595.00	5,514,000

日本ヒューム	11,500	636.00	7,314,000
日本コンクリート工業	25,300	223.00	5,641,900
三谷セキサン	5,400	3,900.00	21,060,000
アジアパイルホールディングス	20,300	559.00	11,347,700
東海カーボン	108,500	1,096.00	118,916,000
日本カーボン	7,400	4,285.00	31,709,000
東洋炭素	8,000	3,880.00	31,040,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,400	3,985.00	25,504,000
TOTO	85,400	5,010.00	427,854,000
日本碍子	153,300	1,701.00	260,763,300
日本特殊陶業	98,500	2,470.00	243,295,000
ダントーホールディングス	9,200	208.00	1,913,600
MARUWA	4,800	16,670.00	80,016,000
品川リフラクトリーズ	3,700	3,895.00	14,411,500
黒崎播磨	2,500	5,440.00	13,600,000
ヨータイ	8,500	1,382.00	11,747,000
東京窯業	11,800	269.00	3,174,200
ニッカトー	5,700	490.00	2,793,000
フジインコーポレーテッド	10,400	6,610.00	68,744,000
クニミネ工業	3,900	825.00	3,217,500
エーアンドエーマテリアル	2,300	873.00	2,007,900
ニチアス	32,700	2,363.00	77,270,100
日本製鉄	596,900	2,455.00	1,465,389,500
神戸製鋼所	268,000	653.00	175,004,000
中山製鋼所	27,500	849.00	23,347,500
合同製鉄	6,500	2,224.00	14,456,000
JFEホールディングス	356,200	1,563.00	556,740,600
東京製鉄	37,300	1,234.00	46,028,200
共英製鋼	15,200	1,282.00	19,486,400
大和工業	22,000	4,645.00	102,190,000
東京鐵鋼	6,300	1,531.00	9,645,300
大阪製鉄	6,100	1,142.00	6,966,200
淀川製鋼所	15,200	2,527.00	38,410,400
丸一鋼管	40,500	2,728.00	110,484,000
モリ工業	3,100	2,761.00	8,559,100
大同特殊鋼	16,800	4,395.00	73,836,000
日本高周波鋼業	4,100	310.00	1,271,000
日本冶金工業	9,700	4,310.00	41,807,000
山陽特殊製鋼	13,100	2,112.00	27,667,200
愛知製鋼	7,700	2,179.00	16,778,300
日本金属	2,700	901.00	2,432,700
大平洋金属	9,500	1,905.00	18,097,500
新日本電工	85,300	374.00	31,902,200
栗本鐵工所	6,300	1,724.00	10,861,200
虹 技	1,600	912.00	1,459,200
日本鑄鉄管	1,400	946.00	1,324,400
日本製鋼所	35,900	2,638.00	94,704,200
三菱製鋼	8,200	1,022.00	8,380,400
日亜鋼業	13,900	247.00	3,433,300
日本精線	1,700	4,265.00	7,250,500

エンビプロ・ホールディングス	9,200	720.00	6,624,000
大紀アルミニウム工業所	18,900	1,299.00	24,551,100
日本軽金属ホールディングス	36,000	1,551.00	55,836,000
三井金属鉱業	38,800	3,175.00	123,190,000
東邦亜鉛	7,800	2,101.00	16,387,800
三菱マテリアル	89,000	2,133.00	189,837,000
住友金属鉱山	154,500	4,930.00	761,685,000
DOWAホールディングス	29,900	4,205.00	125,729,500
古河機械金属	19,500	1,260.00	24,570,000
エス・サイエンス	80,700	26.00	2,098,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,400	3,900.00	75,660,000
東邦チタニウム	24,100	2,652.00	63,913,200
UACJ	18,600	2,336.00	43,449,600
CKサンエツ	2,500	4,005.00	10,012,500
古河電気工業	44,400	2,439.00	108,291,600
住友電気工業	460,300	1,502.00	691,370,600
フジクラ	142,800	979.00	139,801,200
昭和電線ホールディングス	14,800	1,761.00	26,062,800
タツタ電線	27,300	717.00	19,574,100
カナレ電気	2,000	1,391.00	2,782,000
平河ビューテック	7,700	1,124.00	8,654,800
いよぎんホールディングス	151,500	695.00	105,292,500
しずおかフィナンシャルグループ	287,600	1,041.00	299,391,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	107,200	928.00	99,481,600
リョービ	14,100	1,165.00	16,426,500
アーレスティ	14,500	440.00	6,380,000
アサヒホールディングス	53,800	1,950.00	104,910,000
東洋製罐グループホールディングス	88,100	1,574.00	138,669,400
ホッカンホールディングス	7,200	1,370.00	9,864,000
コロナ	7,600	872.00	6,627,200
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,844.00	32,638,800
駒井ハルテック	2,000	1,500.00	3,000,000
高田機工	600	2,462.00	1,477,200
三和ホールディングス	122,800	1,221.00	149,938,800
文化シャッター	38,400	1,097.00	42,124,800
三協立山	18,200	543.00	9,882,600
アルインコ	10,300	974.00	10,032,200
東洋シャッター	2,100	504.00	1,058,400
LIXIL	194,200	2,065.00	401,023,000
日本フィルコン	8,800	446.00	3,924,800
ノーリツ	19,500	1,427.00	27,826,500
長府製作所	13,300	1,929.00	25,655,700
リンナイ	24,100	9,600.00	231,360,000
ユニプレス	23,100	764.00	17,648,400
ダイニチ工業	6,500	651.00	4,231,500
日東精工	19,200	495.00	9,504,000
三洋工業	1,500	1,880.00	2,820,000
岡部	21,500	711.00	15,286,500
ジーテクト	14,800	1,439.00	21,297,200
東プレ	23,400	1,152.00	26,956,800

高周波熱錬	21,800	656.00	14,300,800
東京製綱	7,800	868.00	6,770,400
サンコール	11,800	641.00	7,563,800
モリテックスチール	9,900	267.00	2,643,300
パイオラックス	18,300	1,720.00	31,476,000
エイチワン	13,700	614.00	8,411,800
日本発条	117,800	843.00	99,305,400
中央発条	7,400	724.00	5,357,600
アドバネクス	1,600	1,099.00	1,758,400
三浦工業	54,300	3,130.00	169,959,000
タクマ	40,200	1,224.00	49,204,800
テクノプロ・ホールディングス	89,000	3,455.00	307,495,000
アトラグループ	3,100	184.00	570,400
インターワークス	3,600	351.00	1,263,600
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	1,784.00	12,309,600
Ke e P e r 技研	9,600	3,350.00	32,160,000
ファーストロジック	1,900	855.00	1,624,500
三機サービス	2,200	916.00	2,015,200
G u n o s y	8,000	605.00	4,840,000
デザインワン・ジャパン	3,700	217.00	802,900
イー・ガーディアン	5,000	2,600.00	13,000,000
リブセンス	6,000	280.00	1,680,000
ジャパンマテリアル	40,600	2,235.00	90,741,000
ベクトル	20,900	1,310.00	27,379,000
ウチヤマホールディングス	5,700	266.00	1,516,200
チャーム・ケア・コーポレーション	11,100	1,226.00	13,608,600
キャリアリンク	4,800	2,713.00	13,022,400
I B J	8,000	993.00	7,944,000
アサンテ	6,500	1,614.00	10,491,000
バリューHR	11,500	1,522.00	17,503,000
M&Aキャピタルパートナーズ	12,200	4,625.00	56,425,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,092.00	5,241,600
E R I ホールディングス	3,800	1,170.00	4,446,000
アビスト	1,900	2,925.00	5,557,500
シグマクシス・ホールディングス	20,000	1,209.00	24,180,000
ウィルグループ	11,100	1,205.00	13,375,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,200	144.00	2,044,800
メドピア	10,500	1,375.00	14,437,500
レアジョブ	2,300	941.00	2,164,300
リクルートホールディングス	983,400	4,188.00	4,118,479,200
エラン	17,600	956.00	16,825,600
ツガミ	28,900	1,228.00	35,489,200
オークマ	12,900	4,685.00	60,436,500
芝浦機械	13,000	2,723.00	35,399,000
アマダ	208,100	1,054.00	219,337,400
アイダエンジニアリング	26,800	778.00	20,850,400
TAKI S A W A	3,600	1,082.00	3,895,200
F U J I	56,600	2,044.00	115,690,400

牧野フライス製作所	14,400	4,300.00	61,920,000
オーエスジー	62,300	1,860.00	115,878,000
ダイジェット工業	1,300	824.00	1,071,200
旭ダイヤモンド工業	37,600	700.00	26,320,000
DMG森精機	79,000	1,868.00	147,572,000
ソディック	35,900	735.00	26,386,500
ディスコ	20,900	39,400.00	823,460,000
日東工器	6,300	1,489.00	9,380,700
日進工具	11,000	1,008.00	11,088,000
パンチ工業	11,000	388.00	4,268,000
富士ダイス	6,100	575.00	3,507,500
土木管理総合試験所	5,600	304.00	1,702,400
日本郵政	1,740,600	1,085.50	1,889,421,300
ベルシステム24ホールディングス	17,800	1,354.00	24,101,200
鎌倉新書	15,000	988.00	14,820,000
SMN	3,100	466.00	1,444,600
一蔵	1,600	450.00	720,000
グローバルキッズCOMPANY	1,800	680.00	1,224,000
エアトリ	8,400	2,584.00	21,705,600
アトラエ	10,500	1,218.00	12,789,000
ストライク	6,400	4,225.00	27,040,000
ソラスト	36,500	684.00	24,966,000
セラク	4,800	1,162.00	5,577,600
インソース	33,100	1,433.00	47,432,300
豊田自動織機	94,500	7,450.00	704,025,000
豊和工業	7,100	947.00	6,723,700
ニデックオーケーケー	5,200	916.00	4,763,200
石川製作所	3,300	1,457.00	4,808,100
東洋機械金属	8,900	552.00	4,912,800
津田駒工業	2,300	588.00	1,352,400
エンシュウ	2,600	674.00	1,752,400
島精機製作所	20,800	1,822.00	37,897,600
オプトラン	19,200	2,537.00	48,710,400
NCホールディングス	2,500	2,086.00	5,215,000
イワキ	8,500	1,223.00	10,395,500
フリーー	13,500	1,053.00	14,215,500
ヤマシンフィルタ	31,000	506.00	15,686,000
日阪製作所	12,600	817.00	10,294,200
やまびこ	21,400	1,087.00	23,261,800
野村マイクロ・サイエンス	4,500	4,305.00	19,372,500
平田機工	6,100	5,810.00	35,441,000
ペガサスミシン製造	14,300	775.00	11,082,500
マルマエ	6,200	1,613.00	10,000,600
タツモ	7,100	1,691.00	12,006,100
ナブテスコ	81,900	3,455.00	282,964,500
三井海洋開発	16,400	1,363.00	22,353,200
レオン自動機	13,700	1,035.00	14,179,500
SMC	42,300	60,710.00	2,568,033,000
ホソカワミクロン	10,000	2,678.00	26,780,000
ユニオンツール	5,700	3,250.00	18,525,000

オイレス工業	18,200	1,455.00	26,481,000
日精エー・エス・ビー機械	5,800	4,335.00	25,143,000
サトーホールディングス	18,500	1,904.00	35,224,000
技研製作所	13,500	2,905.00	39,217,500
日本エアテック	6,500	1,057.00	6,870,500
カワタ	3,800	823.00	3,127,400
日精樹脂工業	9,700	932.00	9,040,400
オカダアイヨン	4,100	1,535.00	6,293,500
ワイエイシイホールディングス	5,400	2,014.00	10,875,600
小松製作所	611,300	2,889.50	1,766,351,350
住友重機械工業	77,100	2,667.00	205,625,700
日立建機	52,000	2,939.00	152,828,000
日工	19,300	615.00	11,869,500
巴工業	5,500	2,290.00	12,595,000
井関農機	12,100	1,183.00	14,314,300
TOWA	13,200	1,862.00	24,578,400
丸山製作所	2,100	1,548.00	3,250,800
北川鉄工所	5,100	1,123.00	5,727,300
シンニッタン	14,400	224.00	3,225,600
ローツェ	6,700	7,870.00	52,729,000
タカキタ	3,800	395.00	1,501,000
クボタ	690,500	1,837.50	1,268,793,750
荏原実業	6,400	2,226.00	14,246,400
東洋エンジニアリング	16,800	591.00	9,928,800
三菱化工機	4,300	2,092.00	8,995,600
月島機械	17,700	962.00	17,027,400
帝国電機製作所	9,900	2,274.00	22,512,600
東京機械製作所	3,000	548.00	1,644,000
新東工業	26,300	666.00	17,515,800
澁谷工業	12,200	2,314.00	28,230,800
アイチコーポレーション	18,400	763.00	14,039,200
小森コーポレーション	30,200	806.00	24,341,200
鶴見製作所	10,000	1,990.00	19,900,000
日本ギア工業	4,400	362.00	1,592,800
酒井重工業	1,900	3,435.00	6,526,500
荏原製作所	53,300	4,870.00	259,571,000
石井鐵工所	1,000	2,181.00	2,181,000
西島製作所	11,200	1,471.00	16,475,200
北越工業	13,000	1,299.00	16,887,000
ダイキン工業	155,700	21,510.00	3,349,107,000
オルガノ	17,900	3,020.00	54,058,000
トーヨーカネツ	4,900	2,570.00	12,593,000
栗田工業	72,900	5,590.00	407,511,000
椿本チエイン	18,400	3,005.00	55,292,000
大同工業	5,200	743.00	3,863,600
日機装	32,200	959.00	30,879,800
木村化工機	9,900	728.00	7,207,200
レイズネクスト	18,300	1,257.00	23,003,100
アネスト岩田	22,200	857.00	19,025,400
ダイフク	67,200	6,560.00	440,832,000

サムコ	4,300	3,345.00	14,383,500
加藤製作所	6,000	708.00	4,248,000
油研工業	1,600	1,797.00	2,875,200
タダノ	68,800	910.00	62,608,000
フジテック	47,800	3,000.00	143,400,000
CKD	36,000	1,950.00	70,200,000
平和	43,300	2,334.00	101,062,200
理想科学工業	11,500	2,048.00	23,552,000
SANKYO	25,500	4,965.00	126,607,500
日本金銭機械	14,300	1,116.00	15,958,800
マースグループホールディングス	7,600	2,258.00	17,160,800
フクシマガリレイ	9,600	4,200.00	40,320,000
オーイズミ	5,000	484.00	2,420,000
ダイコク電機	7,100	1,971.00	13,994,100
竹内製作所	23,600	2,830.00	66,788,000
アマノ	36,900	2,377.00	87,711,300
JUKI	20,100	621.00	12,482,100
サンデン	19,300	192.00	3,705,600
ジャノメ	13,100	581.00	7,611,100
ブラザー工業	174,400	1,989.00	346,881,600
マックス	16,100	1,912.00	30,783,200
モリタホールディングス	22,700	1,163.00	26,400,100
グローリー	33,800	2,164.00	73,143,200
新晃工業	13,000	1,475.00	19,175,000
大和冷機工業	19,900	1,128.00	22,447,200
セガサミーホールディングス	104,800	1,933.00	202,578,400
日本ピストンリング	4,500	1,227.00	5,521,500
リケン	5,100	2,262.00	11,536,200
TPR	15,300	1,235.00	18,895,500
ツバキ・ナカシマ	32,000	1,028.00	32,896,000
ホシザキ	83,900	4,475.00	375,452,500
大豊工業	11,200	611.00	6,843,200
日本精工	239,700	701.00	168,029,700
NTN	257,100	262.00	67,360,200
ジェイテクト	116,100	922.00	107,044,200
不二越	9,600	3,695.00	35,472,000
ミネベアミツミ	226,900	2,078.00	471,498,200
日本トムソン	31,800	533.00	16,949,400
THK	75,300	2,598.00	195,629,400
ユーシン精機	10,500	666.00	6,993,000
前澤給装工業	9,200	918.00	8,445,600
イーグル工業	14,400	1,072.00	15,436,800
前澤工業	8,300	616.00	5,112,800
日本ピラー工業	12,000	2,976.00	35,712,000
キッツ	48,000	797.00	38,256,000
日立製作所	655,100	6,565.00	4,300,731,500
東芝	251,100	4,558.00	1,144,513,800
三菱電機	1,348,600	1,286.50	1,734,973,900
富士電機	79,200	5,200.00	411,840,000
東洋電機製造	4,700	848.00	3,985,600

安川電機	154,500	4,500.00	695,250,000
シンフォニアテクノロジー	14,300	1,475.00	21,092,500
明電舎	19,700	1,828.00	36,011,600
オリジン	2,700	1,235.00	3,334,500
山洋電気	5,600	5,750.00	32,200,000
デンヨー	9,900	1,508.00	14,929,200
PHCホールディングス	18,100	1,491.00	26,987,100
ソシオネクスト	13,300	6,880.00	91,504,000
ベイカレント・コンサルティング	105,000	4,470.00	469,350,000
Orchestra Holdings	2,700	1,921.00	5,186,700
アイモバイル	6,900	1,169.00	8,066,100
キャリアインデックス	4,700	313.00	1,471,100
MS-Japan	4,400	1,070.00	4,708,000
船場	1,500	703.00	1,054,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,100	1,613.00	75,972,300
フルテック	1,600	1,106.00	1,769,600
グリーンズ	5,000	1,098.00	5,490,000
ツナググループ・ホールディングス	3,800	470.00	1,786,000
GAMEWITH	4,100	319.00	1,307,900
MS&Consulting	1,500	615.00	922,500
ウェルビー	9,700	721.00	6,993,700
エル・ティイー・エス	1,600	2,750.00	4,400,000
ミダックホールディングス	8,000	2,674.00	21,392,000
日総工産	9,900	572.00	5,662,800
キュービーネットホールディングス	6,900	1,348.00	9,301,200
RPAホールディングス	17,900	272.00	4,868,800
三櫻工業	19,600	637.00	12,485,200
マキタ	162,300	3,195.00	518,548,500
東芝テック	19,400	3,555.00	68,967,000
芝浦メカトロニクス	2,300	10,860.00	24,978,000
マブチモーター	32,300	3,655.00	118,056,500
日本電産	317,000	7,085.00	2,245,945,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,600	481.00	4,617,600
トレックス・セミコンダクター	6,000	2,636.00	15,816,000
東光高岳	7,800	1,978.00	15,428,400
ダブル・スコープ	42,600	1,415.00	60,279,000
宮越ホールディングス	5,700	767.00	4,371,900
ダイヘン	11,700	3,985.00	46,624,500
ヤーマン	25,300	1,410.00	35,673,000
JVCケンウッド	118,800	353.00	41,936,400
ミマキエンジニアリング	12,300	606.00	7,453,800
I-PEX	7,200	1,117.00	8,042,400
日新電機	31,200	1,298.00	40,497,600
大崎電気工業	30,900	519.00	16,037,100
オムロン	119,600	6,662.00	796,775,200
日東工業	17,600	2,264.00	39,846,400
IDEC	19,200	2,912.00	55,910,400
正興電機製作所	4,900	952.00	4,664,800

不二電機工業	2,500	1,141.00	2,852,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	42,800	2,164.00	92,619,200
サクサホールディングス	2,600	1,180.00	3,068,000
メルコホールディングス	3,600	3,010.00	10,836,000
テクノメディア	3,200	1,700.00	5,440,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,000	1,373.00	5,492,000
日本電気	184,500	4,555.00	840,397,500
富士通	130,000	18,500.00	2,405,000,000
沖電気工業	59,000	706.00	41,654,000
岩崎通信機	5,700	768.00	4,377,600
電気興業	6,000	1,935.00	11,610,000
サンケン電気	12,000	6,880.00	82,560,000
ナカヨ	2,000	1,063.00	2,126,000
アイホン	7,900	1,813.00	14,322,700
ルネサスエレクトロニクス	851,100	1,256.50	1,069,407,150
セイコーエプソン	173,800	1,972.00	342,733,600
ワコム	103,400	602.00	62,246,800
アルバック	30,900	5,840.00	180,456,000
アクセル	4,800	1,713.00	8,222,400
E I Z O	9,600	3,385.00	32,496,000
ジャパンディスプレイ	501,300	44.00	22,057,200
日本信号	29,700	1,007.00	29,907,900
京三製作所	27,400	402.00	11,014,800
能美防災	17,700	1,553.00	27,488,100
ホーチキ	9,800	1,382.00	13,543,600
星和電機	5,200	434.00	2,256,800
エレコム	31,100	1,358.00	42,233,800
パナソニック ホールディングス	1,541,300	1,110.00	1,710,843,000
シャープ	157,200	1,003.00	157,671,600
アンリツ	91,800	1,272.00	116,769,600
富士通ゼネラル	36,900	3,335.00	123,061,500
ソニーグループ	913,900	11,100.00	10,144,290,000
T D K	206,600	4,370.00	902,842,000
帝国通信工業	5,800	1,413.00	8,195,400
タムラ製作所	55,900	733.00	40,974,700
アルプスアルパイン	116,500	1,213.00	141,314,500
池上通信機	4,200	529.00	2,221,800
日本電波工業	15,600	1,532.00	23,899,200
鈴木	7,600	859.00	6,528,400
メイコー	14,200	2,628.00	37,317,600
日本トリム	2,700	2,657.00	7,173,900
ローランド ディー. ジー.	7,300	2,809.00	20,505,700
フォスター電機	12,000	893.00	10,716,000
SMK	3,100	2,350.00	7,285,000
ヨコオ	10,400	2,173.00	22,599,200
ティアック	20,100	118.00	2,371,800
ホシデン	31,200	1,556.00	48,547,200
ヒロセ電機	21,600	16,470.00	355,752,000
日本航空電子工業	26,700	2,150.00	57,405,000

TOA	15,000	765.00	11,475,000
マクセル	28,300	1,394.00	39,450,200
古野電気	16,900	941.00	15,902,900
スミダコーポレーション	11,900	1,470.00	17,493,000
アイコム	5,000	2,589.00	12,945,000
リオン	5,300	1,792.00	9,497,600
横河電機	142,600	2,156.00	307,445,600
新電元工業	4,900	3,225.00	15,802,500
アズビル	90,200	3,445.00	310,739,000
東亜ディーケーケー	6,000	785.00	4,710,000
日本光電工業	59,600	3,150.00	187,740,000
チノー	5,300	1,799.00	9,534,700
共和電業	12,200	336.00	4,099,200
日本電子材料	8,400	1,433.00	12,037,200
堀場製作所	28,800	5,850.00	168,480,000
アドバンテスト	101,700	8,700.00	884,790,000
小野測器	4,900	379.00	1,857,100
エスペック	10,400	1,889.00	19,645,600
キーエンス	129,200	55,220.00	7,134,424,000
日置電機	6,700	6,260.00	41,942,000
シスメックス	111,300	8,315.00	925,459,500
日本マイクロニクス	21,300	1,348.00	28,712,400
メガチップス	10,700	2,549.00	27,274,300
OBARA GROUP	6,000	3,600.00	21,600,000
IMAGICA GROUP	10,900	661.00	7,204,900
澤藤電機	1,500	1,120.00	1,680,000
デンソー	266,400	6,662.00	1,774,756,800
原田工業	5,700	850.00	4,845,000
コーセル	17,300	1,005.00	17,386,500
イリソ電子工業	11,800	4,370.00	51,566,000
オブテックスグループ	23,600	1,901.00	44,863,600
千代田インテグレ	5,200	2,196.00	11,419,200
レーザーテック	63,700	23,950.00	1,525,615,000
スタンレー電気	91,800	2,586.00	237,394,800
岩崎電気	4,200	2,270.00	9,534,000
ウシオ電機	67,400	1,682.00	113,366,800
岡谷電機産業	10,000	252.00	2,520,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	480.00	5,664,000
エノモト	3,300	1,729.00	5,705,700
日本セラミック	13,000	2,349.00	30,537,000
遠藤照明	5,700	748.00	4,263,600
古河電池	9,500	1,080.00	10,260,000
双信電機	5,200	373.00	1,939,600
山一電機	11,200	1,770.00	19,824,000
図研	11,200	3,030.00	33,936,000
日本電子	32,200	3,680.00	118,496,000
カシオ計算機	96,200	1,335.00	128,427,000
ファナック	126,800	20,825.00	2,640,610,000
日本シイエムケイ	27,500	471.00	12,952,500
エンプラス	3,800	3,690.00	14,022,000

大真空	15,700	707.00	11,099,900
ローム	59,600	9,830.00	585,868,000
浜松ホトニクス	103,700	6,550.00	679,235,000
三井ハイテック	13,200	6,560.00	86,592,000
新光電気工業	45,800	3,680.00	168,544,000
京セラ	200,600	6,555.00	1,314,933,000
協栄産業	1,200	1,693.00	2,031,600
太陽誘電	62,800	4,220.00	265,016,000
村田製作所	391,700	7,050.00	2,761,485,000
双葉電子工業	24,500	532.00	13,034,000
日東電工	94,000	7,770.00	730,380,000
北陸電気工業	4,800	1,259.00	6,043,200
東海理化電機製作所	36,400	1,414.00	51,469,600
ニチコン	26,200	1,264.00	33,116,800
日本ケミコン	12,700	1,603.00	20,358,100
KOA	19,400	1,910.00	37,054,000
三井E&Sホールディングス	59,000	384.00	22,656,000
日立造船	107,000	815.00	87,205,000
三菱重工業	228,200	5,001.00	1,141,228,200
川崎重工業	97,300	2,892.00	281,391,600
IHI	82,200	3,735.00	307,017,000
名村造船所	33,100	385.00	12,743,500
サノヤスホールディングス	17,700	125.00	2,212,500
スプリックス	4,600	880.00	4,048,000
マネジメントソリューションズ	7,300	3,540.00	25,842,000
プロレド・パートナーズ	3,200	510.00	1,632,000
and factory	3,900	359.00	1,400,100
テノ.ホールディングス	1,600	612.00	979,200
フロンティア・マネジメント	4,500	1,336.00	6,012,000
ピアラ	1,900	537.00	1,020,300
コプロ・ホールディングス	2,000	1,049.00	2,098,000
ギークス	1,700	896.00	1,523,200
カーブスホールディングス	40,700	852.00	34,676,400
フォーラムエンジニアリング	7,700	842.00	6,483,400
FAST FITNESS JAPAN	4,600	1,146.00	5,271,600
日本車輛製造	4,900	1,932.00	9,466,800
三菱ロジスネクスト	20,600	671.00	13,822,600
近畿車輛	1,500	1,059.00	1,588,500
一家ホールディングス	3,000	623.00	1,869,000
フルサト・マルカホールディングス	13,500	3,205.00	43,267,500
ヤマエグループホールディングス	7,700	1,430.00	11,011,000
ジャパクラフトホールディングス	4,400	611.00	2,688,400
FPG	51,600	1,049.00	54,128,400
島根銀行	4,300	465.00	1,999,500
じもとホールディングス	8,300	435.00	3,610,500
全国保証	33,200	4,955.00	164,506,000
めぶきフィナンシャルグループ	631,300	326.00	205,803,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,500	1,177.00	12,358,500

東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,300	2,549.00	41,548,700
九州フィナンシャルグループ	223,700	446.00	99,770,200
かんぽ生命保険	154,400	2,198.00	339,371,200
ゆうちょ銀行	362,300	1,136.00	411,572,800
あんしん保証	5,400	269.00	1,452,600
富山第一銀行	31,600	584.00	18,454,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	701,400	545.00	382,263,000
ジェイリース	4,300	2,687.00	11,554,100
西日本フィナンシャルホールディングス	80,500	976.00	78,568,000
イントラスト	4,800	848.00	4,070,400
日本モーゲージサービス	7,100	896.00	6,361,600
CASA	4,800	885.00	4,248,000
アルヒ	15,600	1,010.00	15,756,000
プレミアグループ	21,400	1,598.00	34,197,200
日産自動車	1,835,200	430.20	789,503,040
いすゞ自動車	375,600	1,540.00	578,424,000
トヨタ自動車	7,094,300	1,837.50	13,035,776,250
日野自動車	166,400	502.00	83,532,800
三菱自動車工業	503,900	498.00	250,942,200
エフテック	8,800	510.00	4,488,000
レシップホールディングス	5,100	455.00	2,320,500
GMB	2,400	701.00	1,682,400
ファルテック	2,000	589.00	1,178,000
武蔵精密工業	31,500	1,576.00	49,644,000
日産車体	22,800	817.00	18,627,600
新明和工業	40,500	1,031.00	41,755,500
極東開発工業	22,700	1,450.00	32,915,000
トビー工業	10,500	1,562.00	16,401,000
ティラド	3,200	2,599.00	8,316,800
曙ブレーキ工業	78,900	150.00	11,835,000
タチエス	20,300	1,125.00	22,837,500
NOK	50,000	1,177.00	58,850,000
フタバ産業	34,600	348.00	12,040,800
KYB	12,300	3,460.00	42,558,000
市光工業	18,500	364.00	6,734,000
大同メタル工業	25,200	479.00	12,070,800
プレス工業	57,500	419.00	24,092,500
ミクニ	14,800	331.00	4,898,800
太平洋工業	29,600	1,009.00	29,866,400
河西工業	17,100	132.00	2,257,200
アイシン	99,600	3,550.00	353,580,000
マツダ	427,200	1,013.00	432,753,600
今仙電機製作所	8,100	643.00	5,208,300
本田技研工業	1,050,300	3,140.00	3,297,942,000
スズキ	237,200	4,291.00	1,017,825,200
SUBARU	408,800	2,070.50	846,420,400
安永	5,600	657.00	3,679,200
ヤマハ発動機	202,900	3,025.00	613,772,500

小糸製作所	155,300	2,076.00	322,402,800
T B K	12,800	240.00	3,072,000
エクセディ	21,100	1,613.00	34,034,300
ミツバ	24,100	456.00	10,989,600
豊田合成	37,600	2,045.00	76,892,000
愛三工業	21,400	683.00	14,616,200
盟和産業	1,500	927.00	1,390,500
日本プラスト	10,100	404.00	4,080,400
ヨロズ	12,000	705.00	8,460,000
エフ・シー・シー	22,900	1,332.00	30,502,800
新家工業	2,700	2,087.00	5,634,900
シマノ	52,900	21,580.00	1,141,582,000
テイ・エス テック	59,200	1,514.00	89,628,800
三十三フィナンシャルグループ	11,300	1,578.00	17,831,400
第四北越フィナンシャルグループ	19,800	2,777.00	54,984,600
ひろぎんホールディングス	165,900	647.00	107,337,300
マーキュリアホールディングス	7,500	601.00	4,507,500
おきなわフィナンシャルグループ	12,000	2,318.00	27,816,000
ダイレクトマーケティングミックス	15,200	1,560.00	23,712,000
ポピンズ	1,800	1,723.00	3,101,400
L I T A L I C O	10,400	2,235.00	23,244,000
十六フィナンシャルグループ	16,500	2,849.00	47,008,500
北國フィナンシャルホールディングス	10,800	4,345.00	46,926,000
ネットプロテクションズホールディングス	42,000	514.00	21,588,000
プロクレアホールディングス	15,600	2,148.00	33,508,800
あいちフィナンシャルグループ	17,700	2,277.00	40,302,900
ジャムコ	7,000	1,403.00	9,821,000
小野建	12,500	1,458.00	18,225,000
はるやまホールディングス	5,600	436.00	2,441,600
南陽	2,500	1,932.00	4,830,000
ノジマ	44,600	1,372.00	61,191,200
佐島電機	8,400	1,270.00	10,668,000
カップ・クリエイト	21,500	1,406.00	30,229,000
エコートレーディング	2,400	700.00	1,680,000
伯東	7,800	4,195.00	32,721,000
コンドーテック	10,600	983.00	10,419,800
中山福	7,200	321.00	2,311,200
ライトオン	10,400	592.00	6,156,800
ナガイレーベン	17,300	1,894.00	32,766,200
三菱食品	12,500	3,015.00	37,687,500
良品計画	176,300	1,406.00	247,877,800
パリミキホールディングス	17,300	265.00	4,584,500
松田産業	10,500	2,265.00	23,782,500
第一興商	26,300	3,865.00	101,649,500
メディバルホールディングス	141,700	1,688.00	239,189,600
アドヴァングループ	12,900	837.00	10,797,300
S P K	6,000	1,387.00	8,322,000
萩原電気ホールディングス	5,200	2,459.00	12,786,800
アルビス	4,600	2,368.00	10,892,800

アズワン	19,900	5,570.00	110,843,000
スズデン	4,800	2,237.00	10,737,600
尾家産業	3,300	926.00	3,055,800
シモジマ	9,400	942.00	8,854,800
ドウシシャ	14,400	1,634.00	23,529,600
小津産業	3,100	1,524.00	4,724,400
コナカ	14,800	339.00	5,017,200
高速	7,100	1,720.00	12,212,000
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,624.00	2,598,400
G-7ホールディングス	17,100	1,546.00	26,436,600
たけびし	5,200	1,527.00	7,940,400
イオン北海道	20,100	1,112.00	22,351,200
コジマ	26,200	549.00	14,383,800
ヒマラヤ	4,400	924.00	4,065,600
コーナン商事	18,400	3,320.00	61,088,000
ネットワンシステムズ	48,200	3,380.00	162,916,000
エコス	5,000	1,820.00	9,100,000
ワタミ	16,500	961.00	15,856,500
マルシェ	4,700	390.00	1,833,000
リックス	2,600	2,180.00	5,668,000
システムソフト	45,000	92.00	4,140,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	306,500	2,300.00	704,950,000
丸文	12,100	956.00	11,567,600
西松屋チェーン	30,200	1,499.00	45,269,800
ゼンショーホールディングス	74,900	3,255.00	243,799,500
ハピネット	11,500	1,977.00	22,735,500
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,051.00	9,248,800
ハークスレイ	4,800	811.00	3,892,800
橋本総業ホールディングス	5,400	1,025.00	5,535,000
日本ライフライン	40,100	904.00	36,250,400
サイゼリヤ	22,700	2,924.00	66,374,800
タカショー	11,800	715.00	8,437,000
VTホールディングス	52,000	471.00	24,492,000
アルゴグラフィックス	11,800	3,640.00	42,952,000
魚力	4,300	2,114.00	9,090,200
IDOM	41,300	678.00	28,001,400
日本エム・ディ・エム	7,600	856.00	6,505,600
ポプラ	3,200	140.00	448,000
フジ・コーポレーション	7,700	1,305.00	10,048,500
ユナイテッドアローズ	14,500	1,769.00	25,650,500
進和	9,100	2,004.00	18,236,400
エスケイジャパン	3,300	603.00	1,989,900
ダイトロン	5,300	2,268.00	12,020,400
ハイデイ日高	20,100	1,954.00	39,275,400
シークス	19,300	1,309.00	25,263,700
YU-WA CREATION HOLDINGS	8,000	198.00	1,584,000
コロワイド	62,900	1,789.00	112,528,100
ピーシーデポコーポレーション	15,200	270.00	4,104,000

田中商事	4,100	555.00	2,275,500
オーハシテクニカ	6,700	1,425.00	9,547,500
耆番屋	10,900	4,630.00	50,467,000
白銅	4,900	2,555.00	12,519,500
トップカルチャー	4,600	183.00	841,800
P L A N T	3,200	647.00	2,070,400
スギホールディングス	27,600	5,840.00	161,184,000
ダイコー通産	1,500	1,090.00	1,635,000
薬王堂ホールディングス	7,600	2,781.00	21,135,600
島津製作所	157,400	3,790.00	596,546,000
JMS	11,900	490.00	5,831,000
クボテック	3,100	200.00	620,000
長野計器	9,400	1,096.00	10,302,400
ブイ・テクノロジー	6,200	2,667.00	16,535,400
スター精密	24,500	1,610.00	39,445,000
東京計器	9,900	1,249.00	12,365,100
愛知時計電機	5,000	1,354.00	6,770,000
インターアクション	7,700	1,600.00	12,320,000
オーバル	11,300	461.00	5,209,300
東京精密	28,300	4,435.00	125,510,500
マニー	56,700	1,962.00	111,245,400
ニコン	200,900	1,216.00	244,294,400
トプコン	67,900	1,562.00	106,059,800
オリンパス	807,700	2,406.00	1,943,326,200
理研計器	7,900	4,395.00	34,720,500
S C R E E Nホールディングス	22,100	9,040.00	199,784,000
キヤノン電子	14,300	1,526.00	21,821,800
タムロン	9,700	3,025.00	29,342,500
HOYA	276,000	13,335.00	3,680,460,000
シード	6,500	501.00	3,256,500
ノーリツ鋼機	12,200	2,397.00	29,243,400
A&Dホロンホールディングス	18,700	1,025.00	19,167,500
朝日インテック	170,600	2,220.00	378,732,000
キヤノン	708,800	2,910.00	2,062,608,000
リコー	323,900	990.00	320,661,000
シチズン時計	141,900	580.00	82,302,000
リズム	4,100	1,621.00	6,646,100
大研医器	9,800	449.00	4,400,200
メニコン	44,300	2,780.00	123,154,000
シンシア	1,200	501.00	601,200
KYORITSU	19,200	120.00	2,304,000
中本パックス	4,000	1,595.00	6,380,000
スノーピーク	22,100	2,293.00	50,675,300
パラマウントベッドホールディングス	29,800	2,515.00	74,947,000
トランザクション	9,900	1,192.00	11,800,800
粧美堂	3,700	351.00	1,298,700
ニホンフラッシュ	12,100	880.00	10,648,000
前田工織	14,000	3,130.00	43,820,000
永大産業	14,000	220.00	3,080,000
アートネイチャー	13,200	740.00	9,768,000

バンダイナムコホールディングス	117,800	8,233.00	969,847,400
アイフィスジャパン	3,800	592.00	2,249,600
SHOE I	13,500	5,090.00	68,715,000
フランスベッドホールディングス	16,000	954.00	15,264,000
マーベラス	21,000	684.00	14,364,000
パイロットコーポレーション	20,100	4,715.00	94,771,500
萩原工業	8,400	1,158.00	9,727,200
エイベックス	22,000	1,628.00	35,816,000
フジシールインターナショナル	26,000	1,652.00	42,952,000
タカラトミー	59,600	1,225.00	73,010,000
広済堂ホールディングス	8,500	1,956.00	16,626,000
エステールホールディングス	3,100	624.00	1,934,400
レック	18,400	959.00	17,645,600
タカノ	4,800	668.00	3,206,400
三光合成	17,700	480.00	8,496,000
プロネクス	10,800	953.00	10,292,400
ホクシン	9,900	149.00	1,475,100
ウッドワン	4,400	911.00	4,008,400
大建工業	7,800	2,093.00	16,325,400
きもと	19,100	225.00	4,297,500
凸版印刷	169,000	1,921.00	324,649,000
大日本印刷	153,200	2,606.00	399,239,200
共同印刷	3,700	2,745.00	10,156,500
N I S S H A	24,500	1,854.00	45,423,000
光村印刷	600	1,158.00	694,800
藤森工業	10,300	3,075.00	31,672,500
ヴィア・ホールディングス	18,400	99.00	1,821,600
TAKARA & COMPANY	8,800	2,021.00	17,784,800
前澤化成工業	8,200	1,339.00	10,979,800
未来工業	4,800	1,450.00	6,960,000
アシックス	119,300	2,911.00	347,282,300
ツツミ	2,700	1,868.00	5,043,600
ウェーブロックホールディングス	4,000	612.00	2,448,000
J S P	9,100	1,508.00	13,722,800
ニチハ	16,200	2,646.00	42,865,200
ローランド	9,500	3,530.00	33,535,000
エフピコ	24,400	3,545.00	86,498,000
小松ウオール工業	4,800	1,834.00	8,803,200
ヤマハ	81,400	4,830.00	393,162,000
河合楽器製作所	3,600	2,541.00	9,147,600
クリナップ	14,500	641.00	9,294,500
ピジョン	82,300	2,044.00	168,221,200
天馬	11,100	2,068.00	22,954,800
兼松サステック	600	1,561.00	936,600
キングジム	11,500	880.00	10,120,000
象印マホービン	38,600	1,448.00	55,892,800
リンテック	25,800	2,137.00	55,134,600
信越ポリマー	24,000	1,148.00	27,552,000
東リ	29,400	230.00	6,762,000
イトーキ	26,400	627.00	16,552,800

任天堂	815,700	5,547.00	4,524,687,900
三菱鉛筆	18,300	1,377.00	25,199,100
松風	5,800	2,233.00	12,951,400
タカラスタンダード	25,000	1,346.00	33,650,000
コクヨ	62,200	1,783.00	110,902,600
ナカバヤシ	14,000	474.00	6,636,000
ニフコ	46,700	3,080.00	143,836,000
立川ブラインド工業	6,000	1,152.00	6,912,000
グローブライド	10,500	2,570.00	26,985,000
オカムラ	38,900	1,405.00	54,654,500
バルカー	10,900	2,656.00	28,950,400
MUTOHホールディングス	1,000	1,611.00	1,611,000
伊藤忠商事	842,200	4,055.00	3,415,121,000
丸紅	1,079,200	1,507.00	1,626,354,400
スクロール	20,100	711.00	14,291,100
高島	2,000	2,920.00	5,840,000
ヨンドシーホールディングス	11,700	1,711.00	20,018,700
三陽商会	4,900	1,365.00	6,688,500
長瀬産業	64,200	1,979.00	127,051,800
ナイガイ	4,100	261.00	1,070,100
蝶理	7,300	2,170.00	15,841,000
豊田通商	119,700	4,930.00	590,121,000
オンワードホールディングス	83,800	312.00	26,145,600
三共生興	19,600	478.00	9,368,800
兼松	53,100	1,469.00	78,003,900
美津濃	12,700	2,709.00	34,404,300
ツカモトコーポレーション	1,800	1,350.00	2,430,000
ルックホールディングス	3,800	2,581.00	9,807,800
三井物産	1,000,000	3,808.00	3,808,000,000
日本紙パルプ商事	7,200	4,665.00	33,588,000
東京エレクトロン	91,100	42,990.00	3,916,389,000
カメイ	14,500	1,195.00	17,327,500
東都水産	600	5,150.00	3,090,000
OUGホールディングス	1,900	2,382.00	4,525,800
スターゼン	10,500	2,069.00	21,724,500
セイコーグループ	19,900	3,010.00	59,899,000
山善	36,800	1,016.00	37,388,800
椿本興業	2,000	3,815.00	7,630,000
住友商事	846,400	2,174.00	1,840,073,600
BIPROGY	47,700	3,250.00	155,025,000
内田洋行	5,900	4,550.00	26,845,000
三菱商事	854,700	4,289.00	3,665,808,300
第一実業	4,800	4,355.00	20,904,000
キャノンマーケティングジャパン	31,600	2,893.00	91,418,800
西華産業	5,300	1,570.00	8,321,000
佐藤商事	9,500	1,220.00	11,590,000
菱洋エレクトロ	11,600	2,402.00	27,863,200
東京産業	12,500	736.00	9,200,000
ユアサ商事	12,200	3,520.00	42,944,000
神鋼商事	3,500	5,140.00	17,990,000

トルク	7,400	203.00	1,502,200
阪和興業	24,500	3,705.00	90,772,500
正栄食品工業	9,100	3,885.00	35,353,500
カナデン	11,100	1,106.00	12,276,600
菱電商事	11,100	1,695.00	18,814,500
ニプロ	107,700	1,021.00	109,961,700
岩谷産業	31,000	5,600.00	173,600,000
ナイス	3,800	1,380.00	5,244,000
ニチモウ	1,500	2,902.00	4,353,000
極東貿易	8,000	1,387.00	11,096,000
アステナホールディングス	23,600	426.00	10,053,600
兼松エレクトロニクス	8,200	4,370.00	35,834,000
三愛オプテック	37,600	1,246.00	46,849,600
稲畑産業	27,900	2,398.00	66,904,200
G S I クレオス	7,900	1,489.00	11,763,100
明和産業	18,100	661.00	11,964,100
クワザワホールディングス	4,600	425.00	1,955,000
キムラタン	75,800	21.00	1,591,800
ゴールドウイン	22,900	9,250.00	211,825,000
ユニ・チャーム	269,900	4,802.00	1,296,059,800
デサント	22,300	3,225.00	71,917,500
キング	5,600	494.00	2,766,400
ワキタ	25,100	1,158.00	29,065,800
ヤマトインターナショナル	10,300	240.00	2,472,000
東邦ホールディングス	33,900	2,061.00	69,867,900
サンゲツ	34,300	2,134.00	73,196,200
ミツウロコグループホールディングス	17,600	1,059.00	18,638,400
シナネンホールディングス	4,500	3,840.00	17,280,000
伊藤忠エネクス	33,900	1,048.00	35,527,200
サンリオ	38,700	4,565.00	176,665,500
サンワテクノス	7,000	1,561.00	10,927,000
リョーサン	14,400	2,873.00	41,371,200
新光商事	18,300	1,184.00	21,667,200
トーヨー	5,800	1,645.00	9,541,000
三信電気	5,400	2,327.00	12,565,800
東陽テクニカ	15,000	1,354.00	20,310,000
モスフードサービス	20,000	3,050.00	61,000,000
加賀電子	11,100	4,140.00	45,954,000
三益半導体工業	11,900	2,454.00	29,202,600
都築電気	6,700	1,303.00	8,730,100
ソーダニッカ	10,000	700.00	7,000,000
立花エレテック	10,000	1,743.00	17,430,000
木曽路	20,600	2,081.00	42,868,600
S R S ホールディングス	22,600	882.00	19,933,200
千趣会	25,200	385.00	9,702,000
タカキュー	9,700	74.00	717,800
リテールパートナーズ	20,100	1,272.00	25,567,200
ケーヨー	22,100	888.00	19,624,800
上新電機	12,100	1,931.00	23,365,100
日本瓦斯	73,100	1,992.00	145,615,200

ロイヤルホールディングス	26,200	2,400.00	62,880,000
東天紅	600	754.00	452,400
いなげや	13,200	1,237.00	16,328,400
チヨダ	13,000	770.00	10,010,000
ライフコーポレーション	11,900	2,559.00	30,452,100
リンガーハット	17,700	2,247.00	39,771,900
MrMaxHD	19,100	656.00	12,529,600
テンアライド	14,500	255.00	3,697,500
AOKIホールディングス	25,300	674.00	17,052,200
オークワ	21,900	882.00	19,315,800
コメリ	21,000	2,662.00	55,902,000
青山商事	29,200	867.00	25,316,400
しまむら	16,000	12,490.00	199,840,000
はせがわ	6,400	328.00	2,099,200
高島屋	103,000	1,767.00	182,001,000
松屋	23,100	1,027.00	23,723,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	66,400	1,221.00	81,074,400
近鉄百貨店	4,500	2,523.00	11,353,500
丸井グループ	100,800	2,124.00	214,099,200
クレディセゾン	80,600	1,674.00	134,924,400
アクシアル リテイリング	9,300	3,315.00	30,829,500
井筒屋	6,500	382.00	2,483,000
イオン	463,300	2,691.50	1,246,971,950
イズミ	20,800	2,864.00	59,571,200
フォーバル	5,300	986.00	5,225,800
平和堂	22,800	2,070.00	47,196,000
フジ	20,900	1,818.00	37,996,200
ヤオコー	15,500	6,720.00	104,160,000
ゼビオホールディングス	18,400	907.00	16,688,800
ケーズホールディングス	108,600	1,115.00	121,089,000
PALTAC	21,500	4,610.00	99,115,000
三谷産業	24,100	305.00	7,350,500
Olympicグループ	5,100	512.00	2,611,200
日産東京販売ホールディングス	17,600	289.00	5,086,400
SBI新生銀行	37,500	2,257.00	84,637,500
あおぞら銀行	79,900	2,604.00	208,059,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,079,900	908.00	7,336,549,200
りそなホールディングス	1,624,200	717.90	1,166,013,180
三井住友トラスト・ホールディングス	231,200	4,599.00	1,063,288,800
三井住友フィナンシャルグループ	929,800	5,345.00	4,969,781,000
千葉銀行	354,600	945.00	335,097,000
群馬銀行	246,900	492.00	121,474,800
武蔵野銀行	16,300	2,067.00	33,692,100
千葉興業銀行	29,600	450.00	13,320,000
筑波銀行	55,700	230.00	12,811,000
七十七銀行	40,700	2,109.00	85,836,300
秋田銀行	8,400	1,844.00	15,489,600
山形銀行	14,100	1,150.00	16,215,000
岩手銀行	8,500	1,947.00	16,549,500
東邦銀行	100,800	228.00	22,982,400

東北銀行	6,200	1,005.00	6,231,000
ふくおかフィナンシャルグループ	101,500	2,915.00	295,872,500
スルガ銀行	112,000	416.00	46,592,000
八十二銀行	260,900	548.00	142,973,200
山梨中央銀行	13,000	1,099.00	14,287,000
大垣共立銀行	24,200	1,847.00	44,697,400
福井銀行	11,300	1,489.00	16,825,700
清水銀行	5,000	1,524.00	7,620,000
富山銀行	1,800	1,737.00	3,126,600
滋賀銀行	21,100	2,620.00	55,282,000
南都銀行	19,000	2,530.00	48,070,000
百五銀行	119,800	373.00	44,685,400
京都銀行	40,200	5,790.00	232,758,000
紀陽銀行	45,500	1,527.00	69,478,500
ほくほくフィナンシャルグループ	80,800	956.00	77,244,800
山陰合同銀行	79,500	760.00	60,420,000
鳥取銀行	4,200	1,137.00	4,775,400
百十四銀行	11,500	1,892.00	21,758,000
四国銀行	20,100	952.00	19,135,200
阿波銀行	18,700	2,057.00	38,465,900
大分銀行	7,600	1,996.00	15,169,600
宮崎銀行	8,100	2,459.00	19,917,900
佐賀銀行	7,400	1,730.00	12,802,000
琉球銀行	29,100	877.00	25,520,700
セブン銀行	455,800	260.00	118,508,000
みずほフィナンシャルグループ	1,840,200	1,904.50	3,504,660,900
高知銀行	4,400	699.00	3,075,600
山口フィナンシャルグループ	140,500	858.00	120,549,000
芙蓉総合リース	11,600	8,480.00	98,368,000
みずほリース	18,800	3,310.00	62,228,000
東京センチュリー	23,700	4,430.00	104,991,000
SBIホールディングス	184,100	2,599.00	478,475,900
日本証券金融	50,900	1,127.00	57,364,300
アイフル	210,700	382.00	80,487,400
日本アジア投資	10,100	231.00	2,333,100
長野銀行	4,000	1,380.00	5,520,000
名古屋銀行	8,200	3,330.00	27,306,000
北洋銀行	192,700	257.00	49,523,900
大光銀行	3,900	1,204.00	4,695,600
愛媛銀行	17,200	887.00	15,256,400
トマト銀行	4,300	1,019.00	4,381,700
京葉銀行	59,000	586.00	34,574,000
栃木銀行	58,300	301.00	17,548,300
北日本銀行	4,500	2,064.00	9,288,000
東和銀行	23,200	574.00	13,316,800
福島銀行	13,200	257.00	3,392,400
大東銀行	4,900	689.00	3,376,100
リコーリース	12,000	3,780.00	45,360,000
イオンフィナンシャルサービス	73,000	1,415.00	103,295,000
アコム	227,000	307.00	69,689,000

ジャックス	13,400	3,980.00	53,332,000
オリエントコーポレーション	33,200	1,139.00	37,814,800
オリックス	851,100	2,133.50	1,815,821,850
三菱HCキャピタル	496,000	643.00	318,928,000
ジャフコ グループ	42,400	2,247.00	95,272,800
九州リースサービス	5,900	742.00	4,377,800
トモニホールディングス	102,800	376.00	38,652,800
大和証券グループ本社	909,600	597.00	543,031,200
野村ホールディングス	2,343,400	495.70	1,161,623,380
岡三証券グループ	111,700	401.00	44,791,700
丸三証券	42,300	412.00	17,427,600
東洋証券	42,200	289.00	12,195,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	138,400	366.00	50,654,400
光世証券	2,600	363.00	943,800
水戸証券	34,300	223.00	7,648,900
いちよし証券	23,400	613.00	14,344,200
松井証券	75,300	775.00	58,357,500
SOMPOホールディングス	218,400	5,703.00	1,245,535,200
日本取引所グループ	357,600	1,847.00	660,487,200
マネックスグループ	142,000	475.00	67,450,000
極東証券	15,900	594.00	9,444,600
岩井コスモホールディングス	14,500	1,308.00	18,966,000
アイザワ証券グループ	18,300	709.00	12,974,700
フィデアホールディングス	13,000	1,401.00	18,213,000
池田泉州ホールディングス	162,500	248.00	40,300,000
アニコム ホールディングス	43,100	599.00	25,816,900
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	259,000	4,146.00	1,073,814,000
マネーパートナーズグループ	13,100	276.00	3,615,600
スパークス・グループ	14,100	1,705.00	24,040,500
小林洋行	2,700	221.00	596,700
第一生命ホールディングス	647,800	2,872.00	1,860,481,600
東京海上ホールディングス	1,281,200	2,745.00	3,516,894,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	371.00	2,188,900
イー・ギャランティ	20,500	2,398.00	49,159,000
アサックス	5,800	596.00	3,456,800
NECキャピタルソリューション	6,200	2,145.00	13,299,000
T&Dホールディングス	341,500	1,912.00	652,948,000
アドバンスクリエイト	7,400	1,090.00	8,066,000
三井不動産	553,000	2,362.00	1,306,186,000
三菱地所	767,800	1,655.50	1,271,092,900
平和不動産	20,600	3,560.00	73,336,000
東京建物	121,200	1,578.00	191,253,600
京阪神ビルディング	16,400	1,300.00	21,320,000
住友不動産	230,000	3,030.00	696,900,000
太平洋興発	4,800	820.00	3,936,000
テーオーシー	23,000	643.00	14,789,000
東京楽天地	1,800	4,070.00	7,326,000
レオパレス21	143,300	310.00	44,423,000

スターツコーポレーション	18,200	2,501.00	45,518,200
フジ住宅	17,800	648.00	11,534,400
空港施設	15,500	515.00	7,982,500
明和地所	6,400	716.00	4,582,400
ゴールドクレスト	12,000	1,640.00	19,680,000
リログループ	73,900	2,102.00	155,337,800
エスリード	5,900	1,846.00	10,891,400
日神グループホールディングス	20,300	433.00	8,789,900
日本エスコン	28,600	756.00	21,621,600
MIRARTHホールディングス	64,200	372.00	23,882,400
AVANTIA	6,300	787.00	4,958,100
イオンモール	66,000	1,685.00	111,210,000
毎日コムネット	4,800	691.00	3,316,800
ファースト住建	5,100	1,026.00	5,232,600
ランド	766,300	9.00	6,896,700
カチタス	34,200	3,000.00	102,600,000
東祥	9,300	1,115.00	10,369,500
トーセイ	21,100	1,358.00	28,653,800
穴吹興産	3,000	1,998.00	5,994,000
サンフロンティア不動産	21,100	1,082.00	22,830,200
FJネクストホールディングス	13,300	963.00	12,807,900
インテリックス	3,100	507.00	1,571,700
ランドビジネス	4,800	223.00	1,070,400
サンネクスタグループ	4,300	948.00	4,076,400
グランディハウス	10,800	563.00	6,080,400
東武鉄道	141,800	2,955.00	419,019,000
相鉄ホールディングス	42,600	2,176.00	92,697,600
東急	362,200	1,594.00	577,346,800
京浜急行電鉄	146,500	1,337.00	195,870,500
小田急電鉄	195,700	1,615.00	316,055,500
京王電鉄	68,400	4,620.00	316,008,000
京成電鉄	83,300	3,550.00	295,715,000
富士急行	15,900	4,485.00	71,311,500
東日本旅客鉄道	219,100	7,229.00	1,583,873,900
西日本旅客鉄道	165,000	5,440.00	897,600,000
東海旅客鉄道	99,500	15,640.00	1,556,180,000
西武ホールディングス	156,100	1,405.00	219,320,500
鴻池運輸	22,000	1,519.00	33,418,000
西日本鉄道	34,500	2,383.00	82,213,500
ハマキョウレックス	10,100	3,010.00	30,401,000
サカイ引越センター	6,000	4,210.00	25,260,000
近鉄グループホールディングス	128,900	4,175.00	538,157,500
阪急阪神ホールディングス	172,000	3,755.00	645,860,000
南海電気鉄道	61,600	2,740.00	168,784,000
京阪ホールディングス	53,200	3,445.00	183,274,000
神戸電鉄	3,600	3,135.00	11,286,000
名古屋鉄道	142,400	2,124.00	302,457,600
山陽電気鉄道	9,700	2,108.00	20,447,600
アルプス物流	10,400	1,122.00	11,668,800
トランコム	3,800	7,310.00	27,778,000

ヤマトホールディングス	165,100	2,062.00	340,436,200
山九	32,800	4,695.00	153,996,000
日新	9,800	2,097.00	20,550,600
丸運	6,300	218.00	1,373,400
丸全昭和運輸	7,900	2,943.00	23,249,700
センコーグループホールディングス	68,400	942.00	64,432,800
トナミホールディングス	2,400	3,570.00	8,568,000
ニッコンホールディングス	41,300	2,305.00	95,196,500
日本石油輸送	800	2,152.00	1,721,600
福山通運	9,700	3,010.00	29,197,000
セイノーホールディングス	80,300	1,150.00	92,345,000
エスライン	3,900	791.00	3,084,900
神奈川中央交通	3,800	3,170.00	12,046,000
AZ-COM丸和ホールディングス	31,100	1,588.00	49,386,800
C&Fロジホールディングス	12,300	1,146.00	14,095,800
日本郵船	345,100	3,073.00	1,060,492,300
商船三井	227,300	3,240.00	736,452,000
川崎汽船	109,900	2,774.00	304,862,600
NSユニテッド海運	6,900	3,775.00	26,047,500
明治海運	12,400	685.00	8,494,000
飯野海運	47,300	885.00	41,860,500
共栄タンカー	2,200	931.00	2,048,200
九州旅客鉄道	91,100	2,813.00	256,264,300
SGホールディングス	247,500	1,838.00	454,905,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	48,100	7,240.00	348,244,000
日本航空	316,900	2,592.00	821,404,800
ANAホールディングス	351,000	2,730.50	958,405,500
ビーウィズ	4,100	1,077.00	4,415,700
パスコ	2,400	1,350.00	3,240,000
TREホールディングス	28,000	1,431.00	40,068,000
人・夢・技術グループ	5,800	1,589.00	9,216,200
西本Wismettacホールディングス	3,600	3,550.00	12,780,000
シルバーライフ	3,100	1,823.00	5,651,300
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,549.00	1,858,800
Genky Drug Stores	6,600	3,645.00	24,057,000
コア商事ホールディングス	9,600	616.00	5,913,600
KPPグループホールディングス	31,700	827.00	26,215,900
ナルミヤ・インターナショナル	2,000	897.00	1,794,000
ブックオフグループホールディングス	8,000	1,323.00	10,584,000
ギフトホールディングス	2,700	4,250.00	11,475,000
三菱倉庫	27,700	2,921.00	80,911,700
三井倉庫ホールディングス	12,000	3,565.00	42,780,000
住友倉庫	35,400	1,900.00	67,260,000
澁澤倉庫	5,100	2,044.00	10,424,400
ヤマタネ	6,000	1,677.00	10,062,000
東陽倉庫	17,400	252.00	4,384,800
乾汽船	16,400	1,993.00	32,685,200
日本トランスシティ	25,900	491.00	12,716,900

ケイヒン	2,200	1,458.00	3,207,600
中央倉庫	6,200	936.00	5,803,200
川西倉庫	2,100	995.00	2,089,500
安田倉庫	8,900	927.00	8,250,300
ファイズホールディングス	2,200	852.00	1,874,400
東洋埠頭	3,800	1,254.00	4,765,200
上組	61,800	2,606.00	161,050,800
サンリツ	3,000	723.00	2,169,000
キムラユニティー	6,100	776.00	4,733,600
キューソー流通システム	7,700	915.00	7,045,500
東海運	7,700	282.00	2,171,400
エーアイテイナー	8,000	1,389.00	11,112,000
内外トランスライン	4,700	2,095.00	9,846,500
ショーエイコーポレーション	3,900	562.00	2,191,800
日本コンセプト	4,100	1,508.00	6,182,800
TBSホールディングス	66,200	1,494.00	98,902,800
日本テレビホールディングス	114,500	1,021.00	116,904,500
朝日放送グループホールディングス	12,100	633.00	7,659,300
テレビ朝日ホールディングス	31,300	1,307.00	40,909,100
スカパーJ S A Tホールディングス	114,900	482.00	55,381,800
テレビ東京ホールディングス	9,300	1,850.00	17,205,000
日本BS放送	4,700	902.00	4,239,400
ビジョン	17,100	1,392.00	23,803,200
スマートバリュー	3,200	419.00	1,340,800
USEN-NEXT HOLDINGS	11,500	2,206.00	25,369,000
ワイヤレスゲート	5,600	235.00	1,316,000
コネクシオ	8,500	1,909.00	16,226,500
日本通信	119,500	224.00	26,768,000
クロップス	2,000	944.00	1,888,000
日本電信電話	1,660,300	3,727.00	6,187,938,100
KDDI	1,001,300	3,900.00	3,905,070,000
ソフトバンク	2,081,500	1,463.00	3,045,234,500
光通信	15,300	18,370.00	281,061,000
エムティーアイ	11,800	510.00	6,018,000
GMOインターネットグループ	48,100	2,444.00	117,556,400
ファイバーゲート	6,900	882.00	6,085,800
アイドママーケティングコミュニケーション	3,000	272.00	816,000
KADOKAWA	68,500	2,423.00	165,975,500
学研ホールディングス	21,600	924.00	19,958,400
ゼンリン	22,100	802.00	17,724,200
昭文社ホールディングス	5,500	284.00	1,562,000
インプレスホールディングス	11,300	212.00	2,395,600
東京電力ホールディングス	1,164,500	435.00	506,557,500
中部電力	476,000	1,280.00	609,280,000
関西電力	498,800	1,210.00	603,548,000
中国電力	205,700	666.00	136,996,200
北陸電力	121,800	518.00	63,092,400
東北電力	315,800	662.00	209,059,600

四国電力	110,300	723.00	79,746,900
九州電力	297,800	714.00	212,629,200
北海道電力	124,600	446.00	55,571,600
沖縄電力	30,200	1,026.00	30,985,200
電源開発	97,200	2,028.00	197,121,600
エフオン	9,400	496.00	4,662,400
イーレックス	22,900	2,136.00	48,914,400
レノバ	34,400	2,240.00	77,056,000
東京瓦斯	273,100	2,489.00	679,745,900
大阪瓦斯	261,600	2,023.00	529,216,800
東邦瓦斯	50,700	2,363.00	119,804,100
北海道瓦斯	7,700	1,629.00	12,543,300
広島ガス	27,400	337.00	9,233,800
西部ガスホールディングス	12,000	1,674.00	20,088,000
静岡ガス	29,400	1,061.00	31,193,400
メタウォーター	16,200	1,632.00	26,438,400
アイネット	7,800	1,337.00	10,428,600
松竹	7,400	11,380.00	84,212,000
東宝	81,000	4,830.00	391,230,000
エイチ・アイ・エス	34,700	2,070.00	71,829,000
東映	3,700	17,180.00	63,566,000
ラックランド	4,200	2,901.00	12,184,200
エヌ・ティ・ティ・データ	406,600	1,921.00	781,078,600
共立メンテナンス	22,700	5,880.00	133,476,000
イチネンホールディングス	14,100	1,240.00	17,484,000
建設技術研究所	6,700	3,135.00	21,004,500
スペース	9,700	881.00	8,545,700
アインホールディングス	18,700	5,870.00	109,769,000
燦ホールディングス	5,800	1,746.00	10,126,800
ピー・シー・エー	7,800	1,356.00	10,576,800
スバル興業	600	9,360.00	5,616,000
東京テアトル	4,900	1,119.00	5,483,100
タナベコンサルティンググループ	5,200	635.00	3,302,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,500	1,869.00	10,279,500
ナガワ	3,600	7,610.00	27,396,000
東京都競馬	11,200	3,810.00	42,672,000
常磐興産	4,700	1,215.00	5,710,500
カナモト	24,300	2,250.00	54,675,000
DTS	28,500	2,943.00	83,875,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	65,200	6,400.00	417,280,000
シーイーシー	18,100	1,484.00	26,860,400
カプコン	128,700	4,130.00	531,531,000
西尾レントオール	12,300	3,005.00	36,961,500
アイ・エス・ビー	6,500	1,172.00	7,618,000
アゴーラ ホスピタリティール グループ	75,400	22.00	1,658,800
日本空港ビルデング	45,000	6,500.00	292,500,000
トランス・コスモス	16,500	3,230.00	53,295,000
乃村工藝社	58,000	935.00	54,230,000

ジャステック	7,900	1,147.00	9,061,300
S C S K	105,700	2,035.00	215,099,500
藤田観光	5,800	3,075.00	17,835,000
KNT-CTホールディングス	7,900	1,628.00	12,861,200
日本管財	13,900	2,459.00	34,180,100
トーカイ	11,700	1,882.00	22,019,400
白洋舎	1,200	1,761.00	2,113,200
セコム	135,200	7,405.00	1,001,156,000
NSW	5,000	2,030.00	10,150,000
セントラル警備保障	7,100	2,235.00	15,868,500
アイネス	9,100	1,322.00	12,030,200
丹青社	25,600	712.00	18,227,200
メイテック	53,000	2,398.00	127,094,000
TKC	23,200	3,445.00	79,924,000
富士ソフト	14,500	7,520.00	109,040,000
応用地質	12,800	2,157.00	27,609,600
船井総研ホールディングス	27,900	2,658.00	74,158,200
NSD	46,300	2,236.00	103,526,800
進学会ホールディングス	4,500	297.00	1,336,500
丸紅建材リース	800	1,718.00	1,374,400
オオバ	8,200	651.00	5,338,200
コナミグループ	55,400	5,990.00	331,846,000
いであ	3,000	1,683.00	5,049,000
学究社	5,200	1,830.00	9,516,000
ベネッセホールディングス	49,500	1,933.00	95,683,500
イオンディライト	14,500	2,953.00	42,818,500
ナック	6,000	934.00	5,604,000
福井コンピュータホールディングス	8,900	2,733.00	24,323,700
ダイセキ	27,100	4,470.00	121,137,000
ステップ	5,400	1,784.00	9,633,600
日鉄物産	9,400	9,260.00	87,044,000
泉州電業	6,700	3,110.00	20,837,000
元気寿司	4,400	3,090.00	13,596,000
トラスコ中山	28,700	2,016.00	57,859,200
ヤマダホールディングス	560,500	461.00	258,390,500
オートバックスセブン	47,400	1,410.00	66,834,000
モリト	9,800	723.00	7,085,400
アークランズ	19,900	1,564.00	31,123,600
ニトリホールディングス	55,200	16,465.00	908,868,000
グルメ杵屋	11,200	998.00	11,177,600
愛眼	7,400	166.00	1,228,400
ケーユーホールディングス	8,000	1,310.00	10,480,000
吉野家ホールディングス	53,400	2,280.00	121,752,000
加藤産業	16,600	3,460.00	57,436,000
北恵	3,100	672.00	2,083,200
イノテック	8,500	1,305.00	11,092,500
イエローハット	24,100	1,708.00	41,162,800
松屋フーズホールディングス	6,400	3,900.00	24,960,000
JBCホールディングス	9,500	1,777.00	16,881,500
JKホールディングス	10,800	1,011.00	10,918,800

サガミホールディングス	22,000	1,207.00	26,554,000
日伝	8,000	1,695.00	13,560,000
関西フードマーケット	12,300	1,249.00	15,362,700
ミロク情報サービス	11,700	1,453.00	17,000,100
北沢産業	7,000	190.00	1,330,000
杉本商事	6,000	1,949.00	11,694,000
因幡電機産業	35,400	2,680.00	94,872,000
王将フードサービス	8,900	5,940.00	52,866,000
プレナス	4,300	2,633.00	11,321,900
ミニストップ	10,000	1,409.00	14,090,000
アークス	25,000	2,091.00	52,275,000
バローホールディングス	25,900	1,763.00	45,661,700
東テク	4,600	3,425.00	15,755,000
ミスミグループ本社	206,200	2,975.00	613,445,000
アルテック	7,700	309.00	2,379,300
ベルク	6,700	5,420.00	36,314,000
大 庄	7,400	1,041.00	7,703,400
タキヒヨー	3,300	852.00	2,811,600
ファーストリテイリング	20,500	81,450.00	1,669,725,000
ソフトバンクグループ	749,200	5,969.00	4,471,974,800
蔵王産業	2,100	1,747.00	3,668,700
スズケン	42,500	3,415.00	145,137,500
サンドラッグ	51,900	3,750.00	194,625,000
サックスパー ホールディングス	12,900	741.00	9,558,900
ジェコス	8,900	832.00	7,404,800
ヤマザワ	2,400	1,287.00	3,088,800
やまや	2,700	2,506.00	6,766,200
グローセル	14,900	410.00	6,109,000
ベルーナ	32,800	668.00	21,910,400
合計	151,587,400		353,679,998,270

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,053,655,090
国債証券	454,459,252,500
地方債証券	33,085,236,568
特殊債券	30,336,795,621
社債券	26,305,786,990
未収利息	573,223,919
前払費用	218,738,821
流動資産合計	549,032,689,509
資産合計	549,032,689,509
負債の部	
流動負債	
未払金	890,550,000
未払解約金	3,570,847,000
流動負債合計	4,461,397,000
負債合計	4,461,397,000
純資産の部	
元本等	
元本	441,014,150,576
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	103,557,141,933
元本等合計	544,571,292,509
純資産合計	544,571,292,509
負債純資産合計	549,032,689,509

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年1月12日
	至 2023年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	369,783,791,323円
同期中追加設定元本額	1,169,484,119,608円
同期中一部解約元本額	1,098,253,760,355円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	25,571,332,599円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	58,809,581円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	124,020,616円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	75,850,769円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	742,020,244円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	171,025,697円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	48,241,237円
たわらノーロード 国内債券	17,364,958,987円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,616,037,121円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,199,717,259円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,109,138,614円
たわらノーロード バランス（積極型）	269,480,830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）	104,558,442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）	1,542,760,375円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,666,622,304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）	476,258,871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）	85,583,914円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	26,216,858円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	17,817,056円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	148,222,785円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,644,448円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,867,302,113円
O n e グローバルバランス	17,028,893円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	9,659,577,766円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	13,589,090,732円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	5,756,072,336円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,332,626,189円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,419,618,075円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	410,790,143円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	97,387,528円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,538,729,678円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,441,521円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	4,592,822,348円

D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,937,579,442円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	377,779,353円
投資のソムリエ	80,029,834,906円
クルーズコントロール	169,807,558円
投資のソムリエ<DC年金>	5,784,022,021円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,545,357,902円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,253,348,629円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,328,603,093円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	27,477,190,803円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	486,265,731円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	243,888,522円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	43,535,284円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,900,114,047円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,357,257,288円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,230,472,381円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,384,001,424円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	607,579,349円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	260,718,800円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	161,227,928円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,170,539,158円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	34,161,306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)	1,906,690,506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)	1,951,282,575円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,531,718,947円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,187,822,769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)	1,876,345,673円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	4,856,348,265円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,872,779,890円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,693,642,819円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	1,920,698,394円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,123,851,273円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,647,924,770円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,137,889,400円
A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	572,063,871円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	259,022,731円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	5,397,074,453円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII(適格機関投資家限定)	5,408,411,752円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV(適格機関投資家限定)	5,364,968,629円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	3,234,781,518円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）	42,202,559円
AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,052,664,270円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	73,817,129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）	144,547,692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）	94,214,793円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	20,938,554円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	81,650,343円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	29,866,214円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	321,234円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	23,373,943円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	104,660,524円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	3,040,314,338円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,081,148,646円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,076,894,090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）	63,014,352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）	146,651,765円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	1,806,576,968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）	146,600,056円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	530,150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）	1,969,194,963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）	42,545,996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）	289,097,684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）	442,250,998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）	775,955,494円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	275,148,153円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	95,648,909円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	905,339,373円
動的パッケージファンド<DC年金>	371,987,197円
コア資産形成ファンド	248,361,857円
MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	46,931,506,941円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	49,382,497,717円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	11,120,562,428円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,689,593,873円
計	441,014,150,576円
2. 受益権の総数	441,014,150,576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 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年1月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	△11,417,672,250	
地方債証券	△1,136,858,716	
特殊債券	△1,432,220,894	
社債券	△950,302,050	
合計	△14,937,053,910	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年2月15日から2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在

1口当たり純資産額	1.2348円
(1万口当たり純資産額)	(12,348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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 3 5回 利付国庫債券 (2年)	3,720,000,000	3,720,446,400	
	4 3 7回 利付国庫債券 (2年)	3,850,000,000	3,850,000,000	
	4 3 8回 利付国庫債券 (2年)	3,800,000,000	3,799,696,000	
	4 3 9回 利付国庫債券 (2年)	3,900,000,000	3,899,376,000	
	4 4 0回 利付国庫債券 (2年)	1,700,000,000	1,699,711,000	
	4 4 1回 利付国庫債券 (2年)	1,100,000,000	1,099,802,000	
	4 4 2回 利付国庫債券 (2年)	1,500,000,000	1,499,715,000	
	1 3 9回 利付国庫債券 (5年)	2,550,000,000	2,553,162,000	
	1 4 0回 利付国庫債券 (5年)	5,390,000,000	5,396,575,800	
	1 4 1回 利付国庫債券 (5年)	2,810,000,000	2,814,018,300	
	1 4 2回 利付国庫債券 (5年)	5,230,000,000	5,238,054,200	
	1 4 3回 利付国庫債券 (5年)	3,100,000,000	3,104,712,000	
	1 4 4回 利付国庫債券 (5年)	5,000,000,000	5,007,900,000	
	1 4 5回 利付国庫債券 (5年)	4,850,000,000	4,857,808,500	
	1 4 6回 利付国庫債券 (5年)	4,400,000,000	4,407,084,000	
	1 4 7回 利付国庫債券 (5年)	3,350,000,000	3,344,673,500	
	1 4 8回 利付国庫債券 (5年)	4,910,000,000	4,897,381,300	
	1 4 9回 利付国庫債券 (5年)	4,410,000,000	4,392,977,400	
	1 5 0回 利付国庫債券 (5年)	4,020,000,000	3,997,930,200	
	1 5 1回 利付国庫債券 (5年)	3,500,000,000	3,475,255,000	

年)			
1 5 2回 利付国庫債券 (5年)	2,730,000,000	2,721,482,400	
1 5 3回 利付国庫債券 (5年)	4,710,000,000	4,668,552,000	
1 5 4回 利付国庫債券 (5年)	5,000,000,000	4,969,850,000	
1回 利付国庫債券 (40年)	110,000,000	130,846,100	
2回 利付国庫債券 (40年)	630,000,000	720,354,600	
3回 利付国庫債券 (40年)	540,000,000	619,569,000	
4回 利付国庫債券 (40年)	720,000,000	822,276,000	
5回 利付国庫債券 (40年)	1,010,000,000	1,108,000,300	
6回 利付国庫債券 (40年)	1,040,000,000	1,111,416,800	
7回 利付国庫債券 (40年)	1,210,000,000	1,232,602,800	
8回 利付国庫債券 (40年)	1,190,000,000	1,121,563,100	
9回 利付国庫債券 (40年)	1,950,000,000	1,335,672,000	
10回 利付国庫債券 (40年)	1,770,000,000	1,428,336,900	
11回 利付国庫債券 (40年)	1,280,000,000	993,561,600	
12回 利付国庫債券 (40年)	1,540,000,000	1,061,753,000	
13回 利付国庫債券 (40年)	1,970,000,000	1,348,465,000	
14回 利付国庫債券 (40年)	2,050,000,000	1,500,641,000	
15回 利付国庫債券 (40年)	1,640,000,000	1,308,457,600	
3 3 3回 利付国庫債券 (10年)	6,330,000,000	6,375,322,800	
3 3 4回 利付国庫債券 (10年)	4,420,000,000	4,457,083,800	
3 3 5回 利付国庫債券 (10年)	4,610,000,000	4,647,709,800	
3 3 6回 利付国庫債券 (10年)	3,000,000,000	3,027,870,000	
3 3 7回 利付国庫債券 (10年)	1,900,000,000	1,910,298,000	
3 3 8回 利付国庫債券 (10年)	4,630,000,000	4,667,364,100	
3 3 9回 利付国庫債券 (10年)	5,080,000,000	5,125,110,400	

3 4 0回 利付国庫債券 (10年)	5,240,000,000	5,290,618,400	
3 4 1回 利付国庫債券 (10年)	5,220,000,000	5,258,993,400	
3 4 2回 利付国庫債券 (10年)	3,420,000,000	3,424,890,600	
3 4 3回 利付国庫債券 (10年)	4,190,000,000	4,192,849,200	
3 4 4回 利付国庫債券 (10年)	3,270,000,000	3,268,790,100	
3 4 5回 利付国庫債券 (10年)	5,880,000,000	5,869,592,400	
3 4 6回 利付国庫債券 (10年)	3,990,000,000	3,977,551,200	
3 4 7回 利付国庫債券 (10年)	4,530,000,000	4,509,071,400	
3 4 8回 利付国庫債券 (10年)	4,570,000,000	4,542,442,900	
3 4 9回 利付国庫債券 (10年)	4,750,000,000	4,714,090,000	
3 5 0回 利付国庫債券 (10年)	6,160,000,000	6,103,328,000	
3 5 1回 利付国庫債券 (10年)	3,920,000,000	3,876,997,600	
3 5 2回 利付国庫債券 (10年)	4,660,000,000	4,600,119,000	
3 5 3回 利付国庫債券 (10年)	4,110,000,000	4,049,048,700	
3 5 4回 利付国庫債券 (10年)	3,700,000,000	3,638,506,000	
3 5 5回 利付国庫債券 (10年)	3,330,000,000	3,267,296,100	
3 5 6回 利付国庫債券 (10年)	3,900,000,000	3,818,802,000	
3 5 7回 利付国庫債券 (10年)	3,820,000,000	3,731,299,600	
3 5 8回 利付国庫債券 (10年)	3,350,000,000	3,262,732,500	
3 5 9回 利付国庫債券 (10年)	4,570,000,000	4,438,932,400	
3 6 0回 利付国庫債券 (10年)	4,800,000,000	4,649,232,000	
3 6 1回 利付国庫債券 (10年)	4,620,000,000	4,465,276,200	
3 6 2回 利付国庫債券 (10年)	4,760,000,000	4,590,448,800	
3 6 3回 利付国庫債券 (10年)	4,470,000,000	4,302,598,500	
3 6 4回 利付国庫債券 (10年)	4,600,000,000	4,422,854,000	
3 6 5回 利付国庫債券 (10年)	4,030,000,000	3,875,489,800	

0年)			
366回 利付国庫債券 (10年)	4,180,000,000	4,068,101,400	
367回 利付国庫債券 (10年)	4,200,000,000	4,110,540,000	
368回 利付国庫債券 (10年)	4,400,000,000	4,311,868,000	
1回 利付国庫債券 (30年)	110,000,000	127,277,700	
2回 利付国庫債券 (30年)	100,000,000	113,546,000	
4回 利付国庫債券 (30年)	200,000,000	236,456,000	
6回 利付国庫債券 (30年)	200,000,000	231,828,000	
8回 利付国庫債券 (30年)	500,000,000	558,195,000	
11回 利付国庫債券 (30年)	250,000,000	276,462,500	
12回 利付国庫債券 (30年)	230,000,000	263,722,600	
13回 利付国庫債券 (30年)	150,000,000	170,415,000	
14回 利付国庫債券 (30年)	340,000,000	400,778,400	
15回 利付国庫債券 (30年)	260,000,000	309,550,800	
16回 利付国庫債券 (30年)	240,000,000	285,900,000	
17回 利付国庫債券 (30年)	270,000,000	318,807,900	
18回 利付国庫債券 (30年)	400,000,000	467,904,000	
19回 利付国庫債券 (30年)	280,000,000	327,686,800	
20回 利付国庫債券 (30年)	330,000,000	394,389,600	
21回 利付国庫債券 (30年)	310,000,000	363,236,300	
22回 利付国庫債券 (30年)	290,000,000	347,135,800	
23回 利付国庫債券 (30年)	350,000,000	419,132,000	
24回 利付国庫債券 (30年)	970,000,000	1,162,671,100	
25回 利付国庫債券 (30年)	330,000,000	387,212,100	
26回 利付国庫債券 (30年)	620,000,000	735,586,600	
27回 利付国庫債券 (30年)	620,000,000	743,863,600	

28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	924,077,000	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,019,117,200	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,029,309,600	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	830,491,200	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,133,299,500	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,320,620,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,381,176,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,633,302,000	
36回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	1,981,532,700	
37回 利付国庫債券(30年)	2,260,000,000	2,492,079,400	
38回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,573,453,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,653,315,000	
40回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,440,762,400	
41回 利付国庫債券(30年)	1,170,000,000	1,244,961,900	
42回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,403,028,000	
43回 利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,327,137,500	
44回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,484,686,000	
45回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,400,030,400	
46回 利付国庫債券(30年)	1,570,000,000	1,601,996,600	
47回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,515,012,800	
48回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,176,955,600	
49回 利付国庫債券(30年)	1,390,000,000	1,383,981,300	
50回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,104,478,200	
51回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	999,053,400	
52回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,078,683,200	
53回 利付国庫債券(30年)	1,560,000,000	1,291,102,800	

年)			
54回 利付国庫債券(30年)	1,350,000,000	1,167,790,500	
55回 利付国庫債券(30年)	1,420,000,000	1,224,735,800	
56回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,083,524,400	
57回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,140,342,000	
58回 利付国庫債券(30年)	1,740,000,000	1,486,116,600	
59回 利付国庫債券(30年)	1,420,000,000	1,179,352,600	
60回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,043,268,000	
61回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	856,648,000	
62回 利付国庫債券(30年)	1,270,000,000	987,602,800	
63回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	986,783,700	
64回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	772,129,200	
65回 利付国庫債券(30年)	950,000,000	716,518,500	
66回 利付国庫債券(30年)	1,390,000,000	1,043,375,700	
67回 利付国庫債券(30年)	1,570,000,000	1,233,030,900	
68回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,073,148,400	
69回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,068,960,900	
70回 利付国庫債券(30年)	1,610,000,000	1,290,914,100	
71回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,039,831,000	
72回 利付国庫債券(30年)	1,490,000,000	1,188,915,700	
73回 利付国庫債券(30年)	1,390,000,000	1,108,566,700	
74回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,313,720,800	
75回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,421,625,600	
76回 利付国庫債券(30年)	1,420,000,000	1,356,014,800	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,127,000	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,711,500	

7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	40,000,000	41,254,400	
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	460,000,000	476,178,200	
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	380,000,000	394,565,400	
7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	40,000,000	41,610,800	
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	180,000,000	188,130,600	
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	70,000,000	72,856,000	
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	40,000,000	41,719,200	
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	250,000,000	261,345,000	
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	50,000,000	52,390,500	
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	90,000,000	94,522,500	
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	400,000,000	421,048,000	
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	140,000,000	147,742,000	
8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	70,000,000	74,218,900	
8 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	170,000,000	179,747,800	
8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	590,000,000	628,344,100	
8 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	120,000,000	128,560,800	
8 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	120,000,000	128,179,200	
8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	590,000,000	634,875,400	
8 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	10,000,000	10,726,300	
9 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	470,000,000	506,166,500	
9 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	110,000,000	118,869,300	
9 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1,160,000,000	1,249,018,400	
9 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	370,000,000	398,123,700	
9 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	670,000,000	723,713,900	
9 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	550,000,000	600,776,000	
9 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	120,000,000	130,023,600	

年)			
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	720,627,600	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	173,955,200	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	817,860,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	912,120,200	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	255,106,800	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	556,455,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	177,209,600	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	120,653,500	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	703,827,200	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	552,660,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	661,452,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	752,638,200	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	382,718,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	486,455,200	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	512,591,800	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	819,957,000	
113回 利付国庫債券(20年)	2,170,000,000	2,411,065,300	
114回 利付国庫債券(20年)	1,110,000,000	1,235,696,400	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	403,192,800	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	594,744,800	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,193,264,000	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	616,005,600	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	514,725,200	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	724,129,300	
121回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	706,592,000	

1 2 2回 利付国庫債券 (20年)	570,000,000	625,084,800	
1 2 3回 利付国庫債券 (20年)	1,050,000,000	1,177,795,500	
1 2 4回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	668,448,000	
1 2 5回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	679,386,000	
1 2 6回 利付国庫債券 (20年)	510,000,000	569,246,700	
1 2 7回 利付国庫債券 (20年)	540,000,000	598,492,800	
1 2 8回 利付国庫債券 (20年)	1,370,000,000	1,521,549,400	
1 2 9回 利付国庫債券 (20年)	760,000,000	837,930,400	
1 3 0回 利付国庫債券 (20年)	910,000,000	1,005,140,500	
1 3 1回 利付国庫債券 (20年)	790,000,000	866,045,400	
1 3 2回 利付国庫債券 (20年)	830,000,000	912,078,700	
1 3 3回 利付国庫債券 (20年)	1,030,000,000	1,140,642,600	
1 3 4回 利付国庫債券 (20年)	900,000,000	998,784,000	
1 3 5回 利付国庫債券 (20年)	740,000,000	814,747,400	
1 3 6回 利付国庫債券 (20年)	360,000,000	393,213,600	
1 3 7回 利付国庫債券 (20年)	880,000,000	971,643,200	
1 3 8回 利付国庫債券 (20年)	920,000,000	998,844,000	
1 3 9回 利付国庫債券 (20年)	1,000,000,000	1,095,160,000	
1 4 0回 利付国庫債券 (20年)	2,450,000,000	2,710,386,000	
1 4 1回 利付国庫債券 (20年)	1,560,000,000	1,726,576,800	
1 4 2回 利付国庫債券 (20年)	1,330,000,000	1,484,532,700	
1 4 3回 利付国庫債券 (20年)	1,630,000,000	1,787,278,700	
1 4 4回 利付国庫債券 (20年)	1,350,000,000	1,467,301,500	
1 4 5回 利付国庫債券 (20年)	2,150,000,000	2,377,577,500	
1 4 6回 利付国庫債券 (20年)	2,140,000,000	2,365,727,200	
1 4 7回 利付国庫債券 (20年)	2,490,000,000	2,724,582,900	

0年)			
148回 利付国庫債券 (20年)	2,360,000,000	2,554,487,600	
149回 利付国庫債券 (20年)	2,440,000,000	2,638,274,400	
150回 利付国庫債券 (20年)	2,500,000,000	2,671,725,000	
151回 利付国庫債券 (20年)	2,460,000,000	2,570,011,200	
152回 利付国庫債券 (20年)	2,240,000,000	2,335,558,400	
153回 利付国庫債券 (20年)	2,200,000,000	2,316,534,000	
154回 利付国庫債券 (20年)	2,230,000,000	2,318,040,400	
155回 利付国庫債券 (20年)	2,380,000,000	2,411,749,200	
156回 利付国庫債券 (20年)	2,040,000,000	1,910,766,000	
157回 利付国庫債券 (20年)	2,360,000,000	2,142,714,800	
158回 利付国庫債券 (20年)	2,780,000,000	2,620,511,400	
159回 利付国庫債券 (20年)	2,260,000,000	2,152,039,800	
160回 利付国庫債券 (20年)	2,280,000,000	2,193,656,400	
161回 利付国庫債券 (20年)	2,010,000,000	1,900,173,600	
162回 利付国庫債券 (20年)	2,370,000,000	2,231,426,100	
163回 利付国庫債券 (20年)	2,340,000,000	2,194,101,000	
164回 利付国庫債券 (20年)	2,740,000,000	2,521,183,600	
165回 利付国庫債券 (20年)	2,230,000,000	2,043,995,700	
166回 利付国庫債券 (20年)	1,980,000,000	1,862,823,600	
167回 利付国庫債券 (20年)	2,050,000,000	1,861,748,500	
168回 利付国庫債券 (20年)	1,690,000,000	1,503,711,300	
169回 利付国庫債券 (20年)	1,960,000,000	1,706,121,200	
170回 利付国庫債券 (20年)	1,600,000,000	1,386,288,000	
171回 利付国庫債券 (20年)	1,740,000,000	1,500,541,200	
172回 利付国庫債券 (20年)	1,380,000,000	1,206,396,000	

	173回 利付国庫債券(20年)	2,020,000,000	1,757,824,200	
	174回 利付国庫債券(20年)	1,970,000,000	1,706,433,700	
	175回 利付国庫債券(20年)	2,130,000,000	1,871,247,600	
	176回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,662,994,000	
	177回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,669,141,500	
	178回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	1,913,802,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	2,050,000,000	1,779,154,000	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,040,000,000	1,869,027,600	
	181回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,050,730,000	
	182回 利付国庫債券(20年)	2,180,000,000	2,101,759,800	
国債証券 合計		460,745,000,000	454,459,252,500	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,323,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	108,742,700	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	192,930,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	385,584,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	287,913,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	227,278,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	110,765,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	104,265,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	105,352,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	215,322,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	323,136,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	110,185,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	110,630,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	206,822,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,405,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	395,144,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	392,820,000	
	令和2年度19回 北海道公	100,000,000	95,437,000	

募公債			
36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	239,465,000	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	301,791,000	
213回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,835,000	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	195,844,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	191,718,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	288,345,000	
3回 神奈川県公募公債 3 0年	100,000,000	119,600,000	
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	109,530,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	331,725,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	109,146,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,111,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,474,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	189,848,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	190,844,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	190,026,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	189,206,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	284,115,000	
10回 大阪府公募公債 2 0年	200,000,000	218,532,000	
13回 大阪府公募公債 2 0年	100,000,000	102,004,000	
14回 大阪府公募公債 2 0年	100,000,000	93,059,000	
190回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	296,715,000	
26年度11回 京都府公募 公債	350,000,000	352,271,500	
29年度13回 京都府公募 公債	109,330,000	108,192,968	
令和2年度1回 京都府公募 公債	400,000,000	385,464,000	
令和2年度14回 京都府公 募公債	200,000,000	192,044,000	
26年度17回 兵庫県公募 公債	200,000,000	201,312,000	
令和元年度16回 兵庫県公	200,000,000	192,900,000	

募公債			
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	95,587,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	115,752,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	210,204,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	304,203,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	313,914,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	102,854,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	101,577,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	193,058,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	95,875,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	190,806,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	104,744,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	104,804,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	202,370,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	105,391,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	331,137,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	331,602,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	111,879,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	213,870,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	151,500,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,861,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	194,950,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	216,726,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	98,825,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	192,026,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	83,621,000	

令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	86,171,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	402,932,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	193,246,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	175,156,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	223,758,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	110,542,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	107,691,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	320,898,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	102,338,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	201,290,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,795,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	196,592,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	193,394,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	95,793,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	104,599,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	147,182,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	109,004,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	110,934,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	325,365,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	202,230,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,729,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	189,454,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	103,291,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	101,889,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	91,711,000	
25年度2回 新潟県公募公債	100,000,000	100,621,000	

令和3年度1回 長野県公募 公債 10年	200,000,000	191,506,000	
5回 群馬県公募公債 20 年	100,000,000	106,738,000	
132回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	100,640,000	
142回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	502,025,000	
144回 共同発行市場公募 地方債	400,000,000	402,760,000	
146回 共同発行市場公募 地方債	600,000,000	605,616,000	
148回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	504,955,000	
150回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	302,784,000	
153回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	100,863,000	
157回 共同発行市場公募 地方債	120,000,000	119,588,400	
159回 共同発行市場公募 地方債	200,000,000	199,074,000	
160回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	497,195,000	
166回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	497,990,000	
169回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	497,780,000	
173回 共同発行市場公募 地方債	400,000,000	397,632,000	
174回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,028,000	
178回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,184,000	
179回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	495,980,000	
189回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	98,351,000	
194回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	291,876,000	
196回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	483,785,000	
203回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	96,252,000	
227回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	477,160,000	
228回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	474,450,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,212,000	
26年度1回 長崎県公募公 債	100,000,000	100,709,000	

令和元年度1回 島根県公募公債	200,000,000	180,242,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	191,416,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	100,699,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,385,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	198,106,000	
令和2年 2回 大阪市公募公債	300,000,000	288,654,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	219,856,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	453,510,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	192,014,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	106,635,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	102,517,000	
5回 京都市公募公債 30年定時償還	200,000,000	177,064,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	108,370,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	221,938,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	217,564,000	
26年度4回 神戸市公募公債	100,000,000	100,712,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	296,490,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	155,480,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	385,840,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	117,318,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	109,120,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	106,752,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	111,454,000	
26年度4回 札幌市公募公債 10年	100,000,000	100,581,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	277,800,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	196,894,000	

6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	220,560,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	111,629,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	108,826,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	331,134,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	106,467,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	114,312,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	184,808,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	85,266,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,590,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	185,968,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	297,438,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	92,833,000	
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	296,643,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	193,262,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	191,416,000	
26年度1回 相模原市公募公債	100,000,000	100,655,000	
26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	100,605,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	195,368,000	
地方債証券 合計	33,239,330,000	33,085,236,568	
特殊債券			
9回 新関西国際空港社債	200,000,000	206,822,000	
12回 新関西国際空港社債	200,000,000	204,572,000	
78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	297,990,000	
125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	423,050,000	
127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,572,000	
131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	76,037,000	
156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	381,944,000	
33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,860,000	
1回 高速道路機構債	300,000,000	372,102,000	

19回 高速道路機構債	150,000,000	179,202,000	
26回 高速道路機構債	200,000,000	236,998,000	
36回 高速道路機構債	300,000,000	363,960,000	
50回 高速道路機構債	300,000,000	264,222,000	
75回 日本高速道路保有・ 債務返済機構	100,000,000	109,556,000	
124回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	106,331,000	
139回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	100,573,000	
155回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	102,809,000	
159回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	99,070,000	
162回 日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	98,996,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	90,859,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	179,310,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	91,352,000	
97回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	110,541,000	
116回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	107,380,000	
121回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	500,000,000	544,320,000	
153回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	109,780,000	
188回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	106,618,000	
211回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	100,655,000	
218回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	100,787,000	
220回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	201,614,000	
239回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	300,000,000	308,340,000	
241回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	500,000,000	503,700,000	
250回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	103,830,000	
254回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	100,838,000	
260回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	200,000,000	196,258,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	507,390,000	
268回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	95,849,000	
271回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	300,000,000	298,845,000	
286回 政保日本高速道路	200,000,000	182,046,000	

保有・債務返済機構			
300回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	99,496,000	
309回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	800,000,000	795,576,000	
319回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	200,000,000	187,748,000	
337回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	92,650,000	
398回 政保道路債	300,000,000	224,136,000	
413回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	141,988,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	153,924,000	
420回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	156,202,000	
28回 日本道路・機構承継 債	500,000,000	595,510,000	
1回 地方公共団体金融機構 債券 20年	200,000,000	217,362,000	
1回 地方公共団体金融機構 債券 20年	300,000,000	330,882,000	
2回 地方公共団体金融機構 債券 20年	300,000,000	331,452,000	
13回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	110,572,000	
79回 政保地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	313,752,000	
19回 地方公共団体金融機 構債券	200,000,000	217,564,000	
23回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	108,571,000	
24回 地方公共団体金融機 構債券20年	200,000,000	217,728,000	
F147回 地方公共団体金 融機構債券	200,000,000	207,674,000	
F174回 地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	326,166,000	
36回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	106,663,000	
64回 政保地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	302,220,000	
39回 地方公共団体金融機 構債券	500,000,000	523,950,000	
42回 地方公共団体金融機 構債券 20年	300,000,000	299,961,000	
71回 政保地方公共団体金 融機構債券	100,000,000	100,628,000	
44回 地方公共団体金融機 構債券 20年	200,000,000	205,810,000	
288回 政保地方公共団体 金融機構債券	300,000,000	301,722,000	

8 3回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	398,232,000	
9 1回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,453,000	
5 9回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	93,471,000	
9 6回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	496,015,000	
9 8回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,398,000	
1 0 3回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,126,000	
1 1 3回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,916,000	
7 7回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	248,706,000	
1 0回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	218,769,000	
F 5 3 8回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,210,000	
1 5回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	217,186,000	
4 0回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,609,630	
2 3回 国際協力銀行債券	100,000,000	105,487,000	
9 3回 都市再生債券	100,000,000	102,920,000	
1 0 9回 都市再生機構債券	200,000,000	202,650,000	
1 6 5回 都市再生機構債券	200,000,000	152,388,000	
1 1回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	107,401,000	
2 1回 政保中部国際空港債券	100,000,000	100,738,000	
3 9回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	219,390,000	
6 1回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,728,000	
7 5回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	385,714,000	
8 0回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,755,000	
1 1 5回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,916,000	
1 2 4回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,700,000	
1 4 8回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	267,015,000	
1 5 9回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,873,000	
1 7 2回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,826,000	
1 8 7回 住宅金融支援機構	100,000,000	99,529,000	

債券			
2 2 2回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,436,000	
2 3 0回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,634,000	
2 3 3回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	90,693,000	
3 2 1回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,895,000	
3 2 5回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,895,000	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,712,000	29,840,652	
4 0回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,132,000	45,845,085	
4 3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,170,000	10,215,358	
4 4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,640,000	48,859,366	
5 1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,046,000	29,153,760	
4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	9,878,000	9,917,907	
2 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,383,000	17,104,015	
2 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,900,000	106,978,696	
3 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,088,000	161,685,443	
3 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,684,000	22,511,461	
4 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,633,000	19,373,289	
5 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,835,000	22,590,491	
5 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,949,000	23,730,183	
6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,311,000	29,190,905	
6 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,152,000	70,752,177	
7 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,516,000	32,326,591	
8 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,534,000	38,114,275	
8 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,095,000	38,694,996	
8 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,820,000	42,415,935	
9 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,497,000	43,811,918	

9 3 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	48,900,000	48,387,528	
9 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	55,272,000	55,082,969	
9 9 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	57,179,000	57,320,803	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	214,500,000	206,968,905	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	72,846,000	70,672,275	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	72,496,000	70,421,164	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	72,740,000	70,587,623	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	227,190,000	219,226,990	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	227,262,000	219,151,019	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	154,106,000	148,476,507	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	231,438,000	222,453,576	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	230,994,000	222,040,672	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	399,035,000	384,729,595	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	79,826,000	76,879,622	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	82,171,000	78,234,187	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	263,157,000	249,012,311	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	351,856,000	334,164,680	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	270,273,000	256,853,945	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	277,440,000	263,917,574	
1 7 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	842,580,000	798,799,543	
6 回 沖縄振興開発金融公庫 債券	400,000,000	417,856,000	
2 1 回 沖縄振興開発金融公庫 債券	100,000,000	101,046,000	
い第8 2 8 号 利付商工債	100,000,000	99,945,000	
い第8 4 3 号 利付商工債	100,000,000	99,713,000	
い第8 5 1 号 利付商工債	300,000,000	298,092,000	
い第8 5 4 号 利付商工債	300,000,000	297,531,000	
い第8 5 5 号 利付商工債	200,000,000	198,278,000	
3 6 9 回 利附信金中金債 (5年)	400,000,000	398,328,000	

	377回 利附信金中金債 (5年)	300,000,000	297,942,000	
	7回 広島県・広島市折半保 証広島高速道路債券	100,000,000	100,551,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	109,136,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	196,788,000	
	77回 東日本高速道路社債	300,000,000	294,003,000	
	85回 中日本高速道路債券	300,000,000	298,344,000	
	87回 中日本高速道路債券	400,000,000	396,600,000	
	71回 鉄道建設運輸施設 整備支援機構債券	100,000,000	100,673,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設 整備支援機構債券	100,000,000	100,496,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設 整備支援機構債券	200,000,000	190,420,000	
特殊債券 合計		30,405,236,000	30,336,795,621	
社債券	25回 フランス相互信用連 合銀行(BFCM)円貨社債 (2017)	300,000,000	290,553,000	
	2回 BPCE SA円貨社 債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,372,000	
	6回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,302,000	
	11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債(2 016)	100,000,000	97,860,000	
	25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,696,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	397,144,000	
	16回 成田国際空港社債	100,000,000	100,625,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	83,245,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,168,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	193,024,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	296,892,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,928,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	197,798,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	493,825,000	
	25回 西日本高速道路社債	200,000,000	201,192,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	100,840,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	298,311,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	199,070,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	494,650,000	
	62回 西日本高速道路債券	500,000,000	493,820,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,068,000	
	10回 キリンホールディン グス社債	100,000,000	100,640,000	
	3回 ダイドーグループHD 社債	300,000,000	289,872,000	
	9回 野村不動産ホールディ ングス社債	100,000,000	93,569,000	
	12回 セブン&アイ・ホー ルディングス社債	100,000,000	101,066,000	

14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	198,960,000	
30回 東レ社債	300,000,000	297,753,000	
42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	198,490,000	
49回 住友化学社債	100,000,000	100,795,000	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	186,292,000	
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	98,935,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	289,665,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	467,890,000	
4回 住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,511,000	
4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	292,389,000	
14回 プリヂストン社債	300,000,000	293,586,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	297,099,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	99,862,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	96,262,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	190,826,000	
29回 三菱重工業社債	100,000,000	100,616,000	
58回 川崎重工業社債	300,000,000	284,760,000	
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	97,813,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	201,050,000	
26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	198,424,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	91,820,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	388,000,000	
12回 新生銀行社債	400,000,000	397,644,000	
13回 新生銀行社債	200,000,000	199,148,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	107,605,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	106,280,000	
20回 三井住友信託銀行社債	300,000,000	295,797,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	200,790,000	
11回 セブン銀行社債	200,000,000	200,904,000	
28回 芙蓉総合リース社債	300,000,000	296,010,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	296,295,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	387,320,000	
69回 ホンダファイナンス社債	300,000,000	296,814,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,810,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,273,000	

80回 日立キャピタル社債	200,000,000	191,752,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	285,846,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	97,088,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	197,400,000	
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,804,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	191,366,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	296,199,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	294,492,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	103,366,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	99,955,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	198,590,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	102,299,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	88,907,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	312,630,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	209,456,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	108,980,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,439,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	217,998,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	93,800,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,017,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	89,769,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,792,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	71,246,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	296,766,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	167,712,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	150,356,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,080,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	191,426,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	77,057,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	71,784,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,327,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	167,186,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,283,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,960,000	

4回 東京地下鉄社債	120,000,000	128,095,200	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	70,700,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	288,306,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	191,630,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	387,708,000	
30回 光通信社債	200,000,000	180,290,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	90,305,000	
532回 中部電力社債	200,000,000	190,014,000	
497回 関西電力社債	100,000,000	101,319,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	296,820,000	
530回 関西電力社債	400,000,000	383,508,000	
531回 関西電力社債	200,000,000	170,430,000	
541回 関西電力社債	300,000,000	277,992,000	
396回 中国電力社債	200,000,000	188,160,000	
425回 中国電力社債	100,000,000	94,676,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	101,848,000	
311回 北陸電力社債	100,000,000	100,623,000	
488回 東北電力社債	100,000,000	98,864,000	
521回 東北電力社債	400,000,000	380,720,000	
525回 東北電力社債	200,000,000	195,010,000	
536回 東北電力社債	300,000,000	276,513,000	
320回 四国電力社債	300,000,000	281,589,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	403,268,000	
428回 九州電力社債	100,000,000	100,901,000	
463回 九州電力社債	100,000,000	88,834,000	
466回 九州電力社債	100,000,000	87,590,000	
491回 九州電力社債	300,000,000	278,553,000	
492回 九州電力社債	100,000,000	82,091,000	
493回 九州電力社債	200,000,000	196,634,000	
507回 九州電力社債	200,000,000	189,256,000	
321回 北海道電力社債	261,000,000	263,711,790	
340回 北海道電力社債	300,000,000	296,514,000	
350回 北海道電力社債	200,000,000	176,838,000	
13回 電源開発社債	200,000,000	207,870,000	
54回 電源開発社債	100,000,000	98,167,000	
75回 電源開発社債	200,000,000	185,164,000	
41回 東京瓦斯社債	200,000,000	180,404,000	
52回 東京瓦斯社債	100,000,000	85,177,000	
55回 東京瓦斯社債	100,000,000	81,660,000	
57回 東京瓦斯社債	300,000,000	200,550,000	
7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,790,000	
8回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	182,548,000	
社債券 合計	27,281,000,000	26,305,786,990	
合計		544,187,071,679	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	20,045,538,691
コール・ローン	701,245,493
株式	758,902,393,554
投資信託受益証券	1,387,813,868
投資証券	16,438,191,165
派生商品評価勘定	453,572,789
未収配当金	727,005,199
差入委託証拠金	5,000,860,885
流動資産合計	803,656,621,644
資産合計	803,656,621,644
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	157,739,693
未払解約金	132,471,000
流動負債合計	290,210,693
負債合計	290,210,693
純資産の部	
元本等	
元本	136,103,425,952
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	667,262,984,999
元本等合計	803,366,410,951
純資産合計	803,366,410,951
負債純資産合計	803,656,621,644

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
	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。	
	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
	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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4. 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	2023年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	110,505,806,204円
同期中追加設定元本額	67,449,577,662円
同期中一部解約元本額	41,851,957,914円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	2,885,896,332円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	1,570,182円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	9,868,791円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	31,635,755円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	19,806,701円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	13,703,681円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	20,015,732円
たわらノーロード 先進国株式	41,780,071,157円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	389,136,980円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	3,122,498,117円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	803,536,592円
たわらノーロード バランス (堅実型)	84,703,395円
たわらノーロード バランス (標準型)	729,563,804円
たわらノーロード バランス (積極型)	919,101,327円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	456,933円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	154,199,702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)	458,086,442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)	374,127,446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)	547,399,793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)	650,130円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	20,500,198円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,440,777円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,584,238円
たわらノーロード 全世界株式	569,971,854円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,261,932,028円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	2,740,957,547円
O n e グローバルバランス	3,936,160円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	157,051,956円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	801,207,495円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,049,854,726円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	95,890,173円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	254,881,313円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	249,599,739円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,255,462円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	625,170,428円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	123,209,099円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	170,887,344円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	197,773,572円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	320,757,125円
投資のソムリエ	5,525,197,498円
クルーズコントロール	19,684,327円
投資のソムリエ<DC年金>	399,404,474円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	208,870,039円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	236,034,860円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	399,920,075円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,735,334,229円
ワールドアセットバランス (基本コース)	144,201,865円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	95,332,662円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	24,827,000円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	12,452,181円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,750,822円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	57,205,642円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	140,719,146円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	119,987,740円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	156,421,181円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	29,873,525円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	13,325,336円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	8,232,922円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	103,406,568円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	1,745,486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)	1,221,926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)	1,199,488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)	758,879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)	1,198,559円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	852,212円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	1,104,248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)	449,088,232円
DIAM外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	40,493,896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)	1,109,106,982円
DIAM先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	201,377,880円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,060,843,381円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	144,027,954円
AMOn eマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	1,328,457円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	7,216,287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)	2,045,203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)	2,912,731円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	4,654,846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)	25,783,979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)	50,456,413円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,920,456円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	17,480,514円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,277,021円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	34,214円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,340,512円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	22,406,686円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	163,013,861円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	260,240,407円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	873,451,334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)	45,680,614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)	38,311,434円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	257,785,829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)	10,455,792円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	172,664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)	105,292,969円

D I AM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	9,122,401円
D I AM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	30,924,908円
D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	47,291,972円
D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	99,789,660円
動的パッケージファンド<DC年金>	9,895,958円
コア資産形成ファンド	6,569,591円
MHAM外国株式インデックスファンド (ファンドラップ)	3,727,423,300円
MHAM外国株式インデックスファンド	140,470,398円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	6,736,066円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,261,770,351円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,400,076,236円
計	136,103,425,952円
2. 受益権の総数	136,103,425,952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 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

<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>	<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> <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	2023年1月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
株式	△60,154,235,810	
投資信託受益証券	△132,076,139	
投資証券	△2,537,503,657	
合計	△62,823,815,606	

(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2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち		評価損益（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	2,311,216,779	—	2,313,345,425	2,128,646
イギリス・ポンド	1,700,614,930	—	1,701,987,236	1,372,306
オーストラリア・ドル	113,533,458	—	113,637,115	103,657
オーストラリア・ドル	59,403,762	—	59,445,638	41,876
カナダ・ドル	76,288,536	—	76,289,464	928
ユーロ	361,376,093	—	361,985,972	609,879
合計	2,311,216,779	—	2,313,345,425	2,128,646

(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。

①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。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
 ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 先物取引 買建	28,175,361,223	—	28,469,065,673	293,704,450
合計	28,175,361,223	—	28,469,065,673	293,704,450

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2023年1月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.9026円 (59,026円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,118,663	89.870	100,534,243.810	
	ABBOTT LABORATORIES	213,851	113.850	24,346,936.350	
	AES CORP	79,505	27.230	2,164,921.150	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	108,940	144.800	15,774,512.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	195,897	68.050	13,330,790.850	
	ADOBE INC	57,266	338.700	19,395,994.200	
	CHUBB LTD	50,533	224.770	11,358,302.410	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,919	312.670	8,416,763.730	
	ALLSTATE CORP	32,939	141.260	4,652,963.140	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	82,340	211.340	17,401,735.600	
	AMGEN INC	65,395	273.880	17,910,382.600	
	HESS CORP	33,470	143.620	4,806,961.400	
	AMERICAN EXPRESS CO	77,915	152.000	11,843,080.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	62,653	97.280	6,094,883.840	

AFLAC INC	72,673	72.000	5,232,456.000
AMERICAN INTL GROUP	93,843	63.450	5,954,338.350
ANALOG DEVICES	63,336	169.220	10,717,717.920
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	82,900	67.310	5,579,999.000
VALERO ENERGY CORP	48,490	132.010	6,401,164.900
ANSYS INC	10,831	248.400	2,690,420.400
APPLE INC	1,959,610	130.730	256,179,815.300
APPLIED MATERIALS INC	106,803	108.040	11,538,996.120
ALBEMARLE CORP	13,961	223.900	3,125,867.900
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	69,412	86.230	5,985,396.760
AMEREN CORP	31,621	89.120	2,818,063.520
ARROW ELECTRONICS INC	9,936	111.210	1,104,982.560
AUTODESK INC	26,907	193.430	5,204,621.010
AUTOMATIC DATA PROCESSING	50,947	240.780	12,267,018.660
AUTOZONE INC	2,313	2,435.520	5,633,357.760
AVERY DENNISON CORP	9,514	189.730	1,805,091.220
BALL CORP	36,411	56.090	2,042,292.990
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	158,774	316.350	50,228,154.900
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	90,954	48.010	4,366,701.540
BAXTER INTERNATIONAL INC	63,174	45.740	2,889,578.760
BECTON DICKINSON & CO	35,061	255.370	8,953,527.570
AMETEK INC	27,428	142.810	3,916,992.680
VERIZON COMM INC	514,992	41.950	21,603,914.400
WR BERKLEY CORP	29,191	73.350	2,141,159.850
BEST BUY CO INC	25,405	84.270	2,140,879.350
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	432.920	1,307,851.320
YUM! BRANDS INC	33,465	129.400	4,330,371.000
FIRSTENERGY CORP	67,213	42.590	2,862,601.670
BOEING CO	68,391	206.690	14,135,735.790
ROBERT HALF INTL INC	14,456	75.050	1,084,922.800
BORGWARNER INC	27,800	43.070	1,197,346.000
BOSTON SCIENTIFIC CORP	175,352	46.060	8,076,713.120
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	92.800	1,345,043.200
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	19,529	105.530	2,060,895.370
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,731	1,520.860	4,153,468.660
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	257,999	71.650	18,485,628.350
ONEOK INC	52,652	69.310	3,649,310.120
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	140.980	1,112,473.180
UNITED RENTALS INC	8,287	381.470	3,161,241.890
SEMPRA ENERGY	38,567	157.510	6,074,688.170

FEDEX CORP	29,483	188.740	5,564,621.420
VERISIGN INC	11,850	208.000	2,464,800.000
AMPHENOL CORP	71,112	79.300	5,639,181.600
BROWN-FORMAN CORP	38,405	65.260	2,506,310.300
QUANTA SERVICES INC	17,560	139.510	2,449,795.600
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	5.910	601,431.150
CSX CORP	263,536	32.400	8,538,566.400
COTERRA ENERGY INC	99,916	25.080	2,505,893.280
CAMPBELL SOUP CO	26,978	56.000	1,510,768.000
CONSTELLATION BRANDS INC	19,343	220.000	4,255,460.000
CARDINAL HEALTH INC	31,857	78.130	2,488,987.410
CARLISLE COS INC	6,119	238.850	1,461,523.150
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	9.680	1,280,576.880
CATERPILLAR INC	64,631	250.510	16,190,711.810
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	124.640	1,574,327.840
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	5.600	543,608.800
JPMORGAN CHASE & CO	357,732	138.600	49,581,655.200
CHURCH & DWIGHT CO INC	30,236	81.290	2,457,884.440
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19,878	110.510	2,196,717.780
CINTAS CORP	11,173	444.970	4,971,649.810
CISCO SYSTEMS INC	505,907	48.810	24,693,320.670
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	18.810	1,060,206.840
CLOROX COMPANY	14,322	140.980	2,019,115.560
COCA-COLA CO/THE	502,166	62.130	31,199,573.580
COPART INC	54,011	61.620	3,328,157.820
COGNEX CORP	20,432	51.720	1,056,743.040
COLGATE-PALMOLIVE CO	96,159	78.310	7,530,211.290
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	32,963	153.160	5,048,613.080
MOLINA HEALTHCARE INC	7,434	292.000	2,170,728.000
NRG ENERGY, INC.	28,364	32.860	932,041.040
COMCAST CORP-CL A	541,547	37.880	20,513,800.360
CONAGRA BRANDS INC	55,843	40.440	2,258,290.920
CONSOLIDATED EDISON INC	43,855	98.090	4,301,736.950
CMS ENERGY CORP	36,603	64.890	2,375,168.670
COOPER COS INC	6,342	343.850	2,180,696.700
MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	50.860	1,082,351.660
CORNING INC	95,758	35.840	3,431,966.720
WOLFSPEED INC	15,684	74.230	1,164,223.320
SEALED AIR CORP	17,610	53.940	949,883.400
HEICO CORP-CL A	9,463	122.730	1,161,393.990
CUMMINS INC	16,869	247.720	4,178,788.680
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	65.480	1,311,695.360
DR HORTON INC	40,602	93.580	3,799,535.160
DANAHER CORP	84,457	266.890	22,540,728.730
MOODY'S CORP	20,682	297.250	6,147,724.500

COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	62,906	61.210	3,850,476.260
TARGET CORP	55,931	155.970	8,723,558.070
DEERE & CO	35,044	437.430	15,329,296.920
MORGAN STANLEY	157,543	88.920	14,008,723.560
REPUBLIC SERVICES INC	27,024	125.170	3,382,594.080
COSTAR GROUP INC	47,398	77.830	3,688,986.340
THE WALT DISNEY CO	223,809	95.560	21,387,188.040
DOLLAR TREE INC	26,771	145.880	3,905,353.480
DOVER CORP	17,842	139.300	2,485,390.600
OMNICOM GROUP	26,570	85.800	2,279,706.000
DTE ENERGY CO	23,792	120.020	2,855,515.840
DUKE ENERGY CORP	94,043	105.430	9,914,953.490
DARDEN RESTAURANTS INC	15,676	150.310	2,356,259.560
EBAY INC	67,667	45.090	3,051,105.030
BANK OF AMERICA CORP	883,002	34.120	30,128,028.240
CITIGROUP INC	233,298	48.190	11,242,630.620
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	89.630	1,504,887.700
EATON CORP PLC	47,526	160.410	7,623,645.660
CADENCE DESIGN SYS INC	32,734	164.320	5,378,850.880
DISH NETWORK CORP	24,416	14.830	362,089.280
ECOLAB INC	30,824	152.200	4,691,412.800
PERKINELMER INC	15,649	133.400	2,087,576.600
ELECTRONIC ARTS INC	33,011	124.020	4,094,024.220
SALESFORCE INC	122,661	147.440	18,085,137.840
ERIE INDEMNITY CO	3,372	253.060	853,318.320
EMERSON ELECTRIC CO	71,700	97.820	7,013,694.000
ATMOS ENERGY CORP	17,567	114.300	2,007,908.100
ENTERGY CORP	23,769	107.730	2,560,634.370
EOG RESOURCES INC	71,192	127.610	9,084,811.120
EQUIFAX INC	15,156	205.000	3,106,980.000
EQT CORP	40,996	34.040	1,395,503.840
ESTEE LAUDER COS INC/THE	28,280	262.450	7,422,086.000
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,974	108.540	2,167,977.960
EXXON MOBIL CORP	509,183	110.090	56,055,956.470
FMC CORP	15,534	128.700	1,999,225.800
NEXTERA ENERGY INC	239,711	84.540	20,265,167.940
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,716	409.280	1,930,164.480
FAIR ISAAC CORP	2,962	585.860	1,735,317.320
ASSURANT INC	5,823	126.520	736,725.960
FASTENAL CO	68,855	48.500	3,339,467.500
FIFTH THIRD BANCORP	84,362	34.460	2,907,114.520
M&T BANK CORP	20,766	148.000	3,073,368.000
FIRST HORIZON CORP	69,634	24.550	1,709,514.700
FISERV INC	73,824	101.040	7,459,176.960
FORD MOTOR CO	479,168	12.840	6,152,517.120
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	29.150	1,105,251.400
FREEMPORT-MCMORAN INC	172,370	44.710	7,706,662.700
FIRST CITIZENS BCSHS -CL	1,587	801.980	1,272,742.260

A				
ARTHUR J GALLAGHER & CO	26,269	192.680	5,061,510.920	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	33.320	852,958.680	
GENERAL DYNAMICS CORP	28,725	247.540	7,110,586.500	
GENERAL MILLS INC	72,417	84.050	6,086,648.850	
GENUINE PARTS CO	17,374	169.750	2,949,236.500	
GILEAD SCIENCES INC	151,364	87.140	13,189,858.960	
GARTNER INC	9,564	331.990	3,175,152.360	
MCKESSON CORP	17,325	382.670	6,629,757.750	
NVIDIA CORP	304,283	159.090	48,408,382.470	
GENERAL ELECTRIC CO	132,408	75.270	9,966,350.160	
WW GRAINGER INC	5,466	563.920	3,082,386.720	
HALLIBURTON CO	111,570	40.940	4,567,675.800	
MONSTER BEVERAGE CORP	47,224	100.530	4,747,428.720	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	41,654	357.360	14,885,473.440	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24,320	201.950	4,911,424.000	
HASBRO INC	15,437	64.480	995,377.760	
HENRY SCHEIN INC	17,431	79.970	1,393,957.070	
HEICO CORP	5,185	157.430	816,274.550	
HERSHEY FOODS CORP	18,695	224.780	4,202,262.100	
HP INC	125,955	29.090	3,664,030.950	
F5 INC	6,924	143.940	996,640.560	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	85.240	1,306,047.280	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	31.830	1,391,448.450	
HOLOGIC INC	30,695	80.570	2,473,096.150	
HOME DEPOT INC	125,091	320.630	40,107,927.330	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22,880	111.400	2,548,832.000	
HORMEL FOODS CORP	34,578	45.910	1,587,475.980	
CENTERPOINT ENERGY INC	78,791	30.560	2,407,852.960	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	248.360	894,592.720	
HUBBELL INC	6,903	234.750	1,620,479.250	
HUMANA INC	15,368	481.590	7,401,075.120	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,348	175.380	1,814,832.240	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	181,491	14.470	2,626,174.770	
BIOGEN INC	17,603	281.460	4,954,540.380	
IDEX CORP	9,065	234.800	2,128,462.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	37,531	227.480	8,537,551.880	
INTUIT INC	32,479	388.680	12,623,937.720	
IDEXX LABORATORIES INC	10,162	469.110	4,767,095.820	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	27,989	178.930	5,008,071.770	
INTEL CORP	497,669	29.440	14,651,375.360	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	31,979	115.990	3,709,244.210	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	37.620	1,661,035.860	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	35.690	1,630,283.510	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	178.370	1,454,072.240	
INCYTE CORP	24,449	79.550	1,944,917.950	
JOHNSON & JOHNSON	320,456	175.160	56,131,072.960	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,402	76.200	3,002,432.400	
KLA CORPORATION	17,734	416.270	7,382,132.180	
DEVON ENERGY CORP	74,759	63.130	4,719,535.670	
KELLOGG CO	29,915	70.750	2,116,486.250	
KEYCORP	106,247	18.210	1,934,757.870	
KIMBERLY-CLARK CORP	42,173	135.860	5,729,623.780	
BLACKROCK INC/NEW YORK	18,251	757.280	13,821,117.280	
KROGER CO	82,775	45.980	3,805,994.500	
LAM RESEARCH CORP	16,432	458.610	7,535,879.520	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,890	409.250	2,410,482.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	132.730	1,463,879.170	
AKAMAI TECHNOLOGIES	20,036	87.390	1,750,946.040	
PLUG POWER INC	56,149	14.950	839,427.550	
LENNAR CORP	29,937	96.570	2,891,016.090	
ELI LILLY & CO	98,682	352.750	34,810,075.500	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	45.800	1,289,544.800	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	31.460	564,298.020	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	89,557	178.770	16,010,104.890	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	35,535	155.230	5,516,098.050	
LOCKHEED MARTIN CORP	28,941	462.290	13,379,134.890	
LOEWS CORP	23,530	59.040	1,389,211.200	
LOWE'S COS INC	75,785	201.400	15,263,099.000	
DOMINION ENERGY INC	101,828	61.830	6,296,025.240	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	38.850	1,569,578.850	
MCCORMICK & CO INC	29,367	84.370	2,477,693.790	
MCDONALD'S CORPORATION	89,724	268.910	24,127,680.840	
S&P GLOBAL INC	41,825	354.390	14,822,361.750	
EVEREST RE GROUP LTD	5,353	358.950	1,921,459.350	
MARKEL CORPORATION	1,674	1,371.670	2,296,175.580	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	77,695	77.020	5,984,068.900	
MARSH & MCLENNAN COS	61,050	170.390	10,402,309.500	
MASCO CORP	28,937	50.810	1,470,288.970	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,736	343.960	2,660,874.560	
METLIFE INC	81,792	71.570	5,853,853.440	
MEDTRONIC PLC	161,408	78.890	12,733,477.120	
ACTIVISION BLIZZARD INC	94,367	77.690	7,331,372.230	
CVS HEALTH CORP	158,698	90.650	14,385,973.700	
MERCK & CO. INC.	309,456	110.810	34,290,819.360	
ON SEMICONDUCTOR	54,362	64.270	3,493,845.740	

CORPORATION				
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,593	245.290	2,598,356.970	
MICROSOFT CORP	863,965	228.850	197,718,390.250	
MICRON TECH INC	135,654	57.210	7,760,765.340	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	66,120	75.450	4,988,754.000	
3M CO	67,396	128.130	8,635,449.480	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	115.150	726,711.650	
ENTEGRIS INC	17,709	76.440	1,353,675.960	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	234.130	1,508,967.850	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,578	262.350	5,398,638.300	
ILLUMINA INC	18,747	194.450	3,645,354.150	
XCEL ENERGY INC	64,922	72.110	4,681,525.420	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,716	109.770	1,286,065.320	
NETAPP INC	24,953	64.210	1,602,232.130	
NEWELL BRANDS INC	41,984	14.660	615,485.440	
NEWMONT CORP	99,287	53.150	5,277,104.050	
NVR INC	365	4,828.530	1,762,413.450	
NIKE INC-CL B	155,133	125.840	19,521,936.720	
NORDSON CORP	6,447	241.450	1,556,628.150	
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,997	254.650	7,384,086.050	
EVERSOURCE ENERGY	43,042	85.690	3,688,268.980	
NISOURCE INC	53,270	27.560	1,468,121.200	
NORTHERN TRUST CORP	24,836	94.840	2,355,446.240	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,823	495.790	8,836,465.170	
WELLS FARGO & CO	462,740	42.360	19,601,666.400	
NUCOR CORP	31,660	151.160	4,785,725.600	
CHENIERE ENERGY INC	27,166	146.510	3,980,090.660	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,654	98.500	4,595,419.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	114,744	64.150	7,360,827.600	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,630	306.600	3,565,758.000	
O' REILLY AUTOMOTIVE INC	7,757	826.880	6,414,108.160	
ORACLE CORP	192,714	86.500	16,669,761.000	
PACCAR INC	43,201	100.490	4,341,268.490	
PTC INC	13,665	127.400	1,740,921.000	
EXELON CORP	121,664	43.690	5,315,500.160	
PARKER HANNIFIN CORP	15,434	310.500	4,792,257.000	
PAYCHEX INC	38,461	117.310	4,511,859.910	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	232.250	1,996,421.000	
PPL CORPORATION	88,737	30.170	2,677,195.290	
PEPSICO INC	168,777	177.850	30,016,989.450	
PENTAIR PLC	19,804	47.980	950,195.920	
PFIZER INC	684,875	47.620	32,613,747.500	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	48.800	1,600,444.800	
CONOCOPHILLIPS	155,665	118.080	18,380,923.200	

PG&E CORP	178,257	15.940	2,841,416.580	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	27,268	231.160	6,303,270.880	
ALTRIA GROUP INC	218,091	45.990	10,030,005.090	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	49,864	164.940	8,224,568.160	
BROWN & BROWN INC	30,650	59.870	1,835,015.500	
GARMIN LTD	17,835	98.920	1,764,238.200	
PPG INDUSTRIES INC	28,341	129.780	3,678,094.980	
COSTCO WHOLESALE CORP	54,129	481.400	26,057,700.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,707	117.200	3,247,260.400	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	152.540	2,217,321.440	
PROCTER & GAMBLE CO	291,314	151.890	44,247,683.460	
PROGRESSIVE CORP	70,907	133.020	9,432,049.140	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	60,100	63.670	3,826,567.000	
PULTE GROUP INC	29,050	48.430	1,406,891.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	33,653	105.310	3,543,997.430	
QUALCOMM INC	137,686	116.910	16,096,870.260	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	23,437	110.970	2,600,803.890	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	60.090	1,405,264.740	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,959	698.950	9,057,693.050	
REPLIGEN CORP	6,730	168.450	1,133,668.500	
RESMED INC	17,366	212.680	3,693,400.880	
US BANCORP	170,632	46.660	7,961,689.120	
SEAGEN INC	16,860	132.500	2,233,950.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,851	63.070	2,891,822.570	
ROSS STORES INC	42,360	119.790	5,074,304.400	
ROLLINS INC	25,920	36.500	946,080.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	13,120	443.460	5,818,195.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	13,905	271.660	3,777,432.300	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	58.930	1,619,219.610	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	86.810	1,429,500.270	
ACCENTURE PLC-CL A	77,236	274.930	21,234,493.480	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	168,645	67.310	11,351,494.950	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,232	253.380	3,352,724.160	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	29,595	191.220	5,659,155.900	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	75,043	69.000	5,177,967.000	
BOOKING HOLDINGS INC	4,811	2,220.950	10,684,990.450	
SCHLUMBERGER LTD	171,376	55.960	9,590,200.960	
SCHWAB (CHARLES) CORP	175,962	85.620	15,065,866.440	
POOL CORP	4,660	325.060	1,514,779.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	26,144	125.500	3,281,072.000	

BUNGE LTD	18,642	97.510	1,817,781.420	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	60.990	882,952.230	
ELEVANCE HEALTH INC	29,398	470.680	13,837,050.640	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,104	167.260	3,195,335.040	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,468	87.620	2,581,986.160	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30,476	234.100	7,134,431.600	
CENTENE CORP	70,080	76.120	5,334,489.600	
SVB FINANCIAL GROUP	7,330	252.680	1,852,144.400	
SMITH (A. O.) CORP	14,856	59.860	889,280.160	
SNAP-ON INC	6,118	244.420	1,495,361.560	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	44,592	99.350	4,430,215.200	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	151.970	1,088,865.050	
EDISON INTERNATIONAL	45,008	68.200	3,069,545.600	
SOUTHERN CO	131,528	71.110	9,352,956.080	
TRUIST FINANCIAL CORP	160,237	46.000	7,370,902.000	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	36.210	713,337.000	
AT&T INC	860,287	19.470	16,749,787.890	
CHEVRON CORP	227,013	176.040	39,963,368.520	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	84.030	1,619,258.100	
STATE STREET CORP	46,198	81.460	3,763,289.080	
STARBUCKS CORP	138,714	106.000	14,703,684.000	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	106.860	2,451,047.820	
STRYKER CORP	41,473	263.810	10,940,992.130	
NETFLIX INC	53,857	327.540	17,640,321.780	
GEN DIGITAL INC	73,086	21.600	1,578,657.600	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	55.310	925,336.300	
SYNOPSIS INC	18,779	327.630	6,152,563.770	
SYSCO CORP	62,521	79.960	4,999,179.160	
INTUITIVE SURGICAL INC	43,844	271.360	11,897,507.840	
TELEFLEX INC	5,532	259.480	1,435,443.360	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	10.990	1,481,243.190	
TERADYNE INC	18,512	94.780	1,754,567.360	
TEXAS INSTRUMENTS INC	111,714	178.400	19,929,777.600	
TEXTRON INC	25,824	70.840	1,829,372.160	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	47,854	568.030	27,182,507.620	
GLOBE LIFE INC	12,153	121.530	1,476,954.090	
DAVITA INC	6,813	79.780	543,541.140	
TRACTOR SUPPLY CO	13,690	221.740	3,035,620.600	
BIO-TECHNE CORP	20,652	86.540	1,787,224.080	
TRIMBLE INC	28,676	52.500	1,505,490.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,300	313.070	1,659,271.000	
TYSON FOODS INC	35,684	65.580	2,340,156.720	
UGI CORP	24,160	40.450	977,272.000	
MARATHON OIL CORP	84,059	27.010	2,270,433.590	

UNION PACIFIC CORP	76,466	212.280	16,232,202.480	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	179,195	99.920	17,905,164.400	
UNITEDHEALTH GROUP INC	114,300	486.000	55,549,800.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	147.500	1,194,160.000	
VF CORP	37,887	29.970	1,135,473.390	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	19.890	1,341,918.630	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31,026	288.750	8,958,757.500	
VULCAN MATERIALS CO	16,452	176.750	2,907,891.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	91,706	36.700	3,365,610.200	
WALMART INC	184,019	144.860	26,656,992.340	
WASTE MANAGEMENT INC	50,578	154.910	7,835,037.980	
WATERS CORP	7,511	335.930	2,523,170.230	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	47.470	1,057,868.950	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,653	245.930	2,128,032.290	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	159.020	2,016,214.580	
VAIL RESORTS INC	5,235	250.630	1,312,048.050	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	38.170	1,352,019.570	
WABTEC CORP	20,273	101.240	2,052,438.520	
WHIRLPOOL CORP	6,832	154.700	1,056,910.400	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	97.510	1,836,405.830	
WYNN RESORTS LTD	12,757	97.470	1,243,424.790	
NASDAQ INC	41,596	62.540	2,601,413.840	
CME GROUP INC	44,342	177.500	7,870,705.000	
WILLIAMS COS INC	151,890	32.140	4,881,744.600	
LKQ CORP	31,504	56.170	1,769,579.680	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	54.970	1,597,758.020	
WEC ENERGY GROUP INC	38,318	96.720	3,706,116.960	
CARMAX INC	18,673	67.390	1,258,373.470	
TJX COMPANIES INC	140,433	82.440	11,577,296.520	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	286.930	1,709,528.940	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.760	544,301.240	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,328	51.000	883,728.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15,092	219.500	3,312,694.000	
SIGNATURE BANK	7,996	114.510	915,621.960	
CBRE GROUP INC	41,089	82.730	3,399,292.970	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	20.810	328,360.990	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,099	22.030	2,359,390.970	
DOMINO' S PIZZA INC	4,115	339.730	1,397,988.950	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,387	388.170	2,091,071.790	
WESTLAKE CORP	4,187	110.770	463,793.990	
T-MOBILE US INC	75,987	149.560	11,364,615.720	

LAS VEGAS SANDS CORP	42,972	53.800	2,311,893.600
MOSAIC CO/THE	42,561	44.830	1,908,009.630
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	321.120	1,346,456.160
CELANESE CORP	13,841	118.530	1,640,573.730
DEXCOM INC	48,710	110.880	5,400,964.800
EXPEDIA GROUP INC	19,186	94.640	1,815,763.040
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	83.000	1,994,241.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,123	319.770	4,196,341.710
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	36,034	21.520	775,451.680
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	67,741	106.650	7,224,577.650
LIVE NATION	20,444	72.560	1,483,416.640
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,304	1,451.430	4,795,524.720
TRANSDIGM GROUP INC	6,148	658.800	4,050,302.400
MASTERCARD INC	105,296	371.010	39,065,868.960
WESTERN UNION CO	46,712	14.450	674,988.400
OWENS CORNING	13,227	89.690	1,186,329.630
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	99.980	1,510,497.840
AERCAP HOLDINGS NV	17,861	60.650	1,083,269.650
FIRST SOLAR INC	11,903	171.010	2,035,532.030
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	13,610	139.030	1,892,198.300
DELTA AIR LINES INC	15,786	38.090	601,288.740
INSULET CORP	8,834	299.060	2,641,896.040
DISCOVER FINANCIAL	33,236	105.610	3,510,053.960
TE CONNECTIVITY LTD	38,762	122.700	4,756,097.400
MASIMO CORP	5,688	153.450	872,823.600
LULULEMON ATHLETICA INC	13,904	309.480	4,303,009.920
VMWARE INC	24,654	124.260	3,063,506.040
MERCADOLIBRE INC	5,418	915.780	4,961,696.040
ULTA BEAUTY INC	6,073	488.620	2,967,389.260
INVESCO LTD	38,530	19.520	752,105.600
MSCI INC	9,807	488.080	4,786,600.560
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	189,517	102.190	19,366,742.230
VISA INC	199,385	221.090	44,082,029.650
KEURIG DR PEPPER INC	92,816	35.690	3,312,603.040
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22,809	160.770	3,667,002.930
MARATHON PETROLEUM CORP	60,388	116.500	7,035,202.000
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	61.290	991,794.780
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	241,328	18.740	4,522,486.720
XYLEM INC	22,848	112.940	2,580,453.120
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	33,342	91.680	3,056,794.560

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	223.970	1,055,570.610
SPLUNK INC	20,898	86.520	1,808,094.960
EPAM SYSTEMS INC	7,090	326.880	2,317,579.200
HCA HEALTHCARE INC	27,835	250.400	6,969,884.000
VERISK ANALYTICS INC	18,974	183.540	3,482,487.960
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	152.600	1,189,059.200
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	191.930	1,697,428.920
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	22,434	126.730	2,843,060.820
NXP SEMICONDUCTOR NV	32,109	166.070	5,332,341.630
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	16,343	97.140	1,587,559.020
TARGA RESOURCES CORP	25,830	74.390	1,921,493.700
LEAR CORP	6,911	134.930	932,501.230
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,709	122.490	1,556,725.410
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,335	53.370	1,405,498.950
DOLLAR GENERAL CORP	27,899	241.760	6,744,862.240
FORTINET INC	81,166	48.420	3,930,057.720
HORIZON PHARMA PLC	27,613	113.060	3,121,925.780
TESLA INC	325,351	118.850	38,667,966.350
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	109.560	757,497.840
ENPHASE ENERGY INC	16,090	229.830	3,697,964.700
GENERAL MOTORS CO	171,210	37.110	6,353,603.100
ALLY FINANCIAL INC	39,230	26.710	1,047,833.300
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9,661	225.780	2,181,260.580
APTIV PLC	34,310	99.640	3,418,648.400
PHILLIPS 66	59,404	101.570	6,033,664.280
META PLATFORMS INC	279,047	132.990	37,110,460.530
IQVIA HOLDINGS INC	22,514	215.510	4,851,992.140
DIAMONDBACK ENERGY INC	20,087	141.950	2,851,349.650
SERVICENOW INC	24,507	380.840	9,333,245.880
PALO ALTO NETWORKS INC	36,942	134.190	4,957,246.980
WORKDAY INC	24,052	160.210	3,853,370.920
ABBVIE INC	215,856	159.640	34,459,251.840
ZOETIS INC	57,061	154.360	8,807,935.960
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	19.390	1,051,151.290
CDW CORP	16,465	186.380	3,068,746.700
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	40.550	1,719,847.150
TWILIO INC	21,090	50.420	1,063,357.800
SNAP INC	127,318	9.420	1,199,335.560
TRADE DESK INC A	53,230	44.840	2,386,833.200
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,466	64.550	1,450,180.300
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	40.400	357,338.000
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	40.320	801,198.720
OKTA INC	17,828	67.990	1,212,125.720

BLACK KNIGHT INC	17,653	61.920	1,093,073.760	
BAKER HUGHES CO	126,292	30.870	3,898,634.040	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,167	98.050	1,781,274.350	
BROADCOM INC	49,306	574.930	28,347,498.580	
ARES MANAGEMENT CORP	19,534	72.430	1,414,847.620	
MONGODB INC	7,891	182.090	1,436,872.190	
BURLINGTON STORES INC	8,453	220.610	1,864,816.330	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	12.980	795,946.580	
VEEVA SYSTEMS INC	16,856	161.200	2,717,187.200	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,212	44.110	1,067,991.320	
EVERGY INC	28,226	64.180	1,811,544.680	
ALLEGION PLC	10,140	112.040	1,136,085.600	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	62.960	1,153,049.440	
STERIS PLC	12,524	201.520	2,523,836.480	
DOCUSIGN INC	26,362	58.050	1,530,314.100	
WIX.COM LTD	5,855	76.850	449,956.750	
DROPBOX INC	30,479	22.450	684,253.550	
KKR & CO INC	67,430	50.130	3,380,265.900	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	47.190	238,309.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,921	70.860	1,978,482.060	
MODERNA INC	40,114	189.650	7,607,620.100	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	34,409	129.460	4,454,589.140	
ARAMARK	31,133	44.050	1,371,408.650	
CIGNA CORP	37,115	303.790	11,275,165.850	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	42.490	1,392,397.300	
DOW INC	87,667	56.470	4,950,555.490	
OVINTIV INC	31,603	49.000	1,548,547.000	
AMCOR PLC	172,505	12.120	2,090,760.600	
PINTEREST INC	69,746	25.940	1,809,211.240	
FOX CORP-A	36,501	31.890	1,164,016.890	
FOX CORP-B	15,511	29.980	465,019.780	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	9.490	404,141.140	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	25,723	95.670	2,460,919.410	
CHEWY INC	9,648	40.990	395,471.520	
AVANTOR INC	78,214	21.470	1,679,254.580	
DYNATRACE INC	25,429	36.690	932,990.010	
CLOUDFLARE INC	29,770	41.800	1,244,386.000	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	68.770	949,026.000	
CARRIER GLOBAL CORP	101,898	44.000	4,483,512.000	
OTIS WORLDWIDE CORP	50,475	81.670	4,122,293.250	
UBER TECHNOLOGIES INC	181,560	28.040	5,090,942.400	
CORTEVA INC	86,360	61.750	5,332,730.000	
MATCH GROUP INC	35,259	44.970	1,585,597.230	
FERGUSON PLC	25,702	139.450	3,584,143.900	
BILL.COM HOLDINGS INC	11,988	101.650	1,218,580.200	
BLACKSTONE INC	85,115	80.530	6,854,310.950	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	187.180	996,171.960	

CARLYLE GROUP INC	24,530	32.560	798,696.800
DATADOG INC	29,179	66.770	1,948,281.830
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	56.460	1,259,509.680
INGERSOLL RAND INC	51,479	56.430	2,904,959.970
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	44,135	60.000	2,648,100.000
PAYCOM SOFTWARE INC	6,341	298.340	1,891,773.940
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	16.450	630,725.900
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	17.530	162,450.510
UNITY SOFTWARE INC	30,839	31.140	960,326.460
AON PLC	25,506	307.330	7,838,758.980
WARNER BROS DISCOVERY INC	275,379	12.560	3,458,760.240
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	2,093.410	1,540,749.760
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	37.240	840,357.840
COINBASE GLOBAL INC	13,094	43.230	566,053.620
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	10.060	186,391.680
AIRBNB INC	47,177	88.540	4,177,051.580
CONSTELLATION ENERGY CORP	38,995	83.080	3,239,704.600
ROYALTY PHARMA PLC	41,775	39.260	1,640,086.500
ROBLOX CORP	45,019	32.010	1,441,058.190
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	25.470	755,338.320
VIATRIS INC	150,826	11.840	1,785,779.840
CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,444	45.300	1,197,913.200
CHESAPEAKE ENERGY CORP	12,687	88.370	1,121,150.190
HF SINCLAIR CORP	20,299	51.700	1,049,458.300
SNOWFLAKE INC	26,591	137.940	3,667,962.540
DOORDASH INC	29,575	48.040	1,420,783.000
ARISTA NETWORKS INC	29,367	115.230	3,383,959.410
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	47,354	66.520	3,149,988.080
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	202,824	6.700	1,358,920.800
FNF GROUP	31,004	40.040	1,241,400.160
JACOBS SOLUTIONS INC	14,561	127.500	1,856,527.500
MARVELL TECHNOLOGY INC	101,624	37.010	3,761,104.240
APA CORP	40,946	43.240	1,770,505.040
LUCID GROUP INC	44,910	7.190	322,902.900
U-HAUL HOLDING CO	11,981	57.190	685,193.390
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	202.070	751,902.470
TOAST INC	32,620	18.320	597,598.400
GRAB HOLDINGS LTD	168,328	3.720	626,180.160
CATALENT INC	20,564	48.100	989,128.400
SYNCHRONY FINANCIAL	61,118	32.840	2,007,115.120
CITIZENS FINANCIAL GROUP	63,378	41.260	2,614,976.280

INC				
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	120.300	630,011.100	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,209	178.010	3,953,424.090	
HUBSPOT INC	5,802	289.070	1,677,184.140	
QORVO INC	11,596	96.180	1,115,303.280	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	85.360	1,308,995.600	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	6,728	285.480	1,920,709.440	
GODADDY INC	19,713	73.040	1,439,837.520	
ETSY INC	15,614	126.930	1,981,885.020	
TRANSUNION	22,126	64.100	1,418,276.600	
ALCOA CORP	19,669	52.980	1,042,063.620	
BLOCK INC	66,910	70.030	4,685,707.300	
DUPONT DE NEMOURS INC	60,266	73.920	4,454,862.720	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	56.000	1,468,376.000	
WESTROCK CO	27,826	36.710	1,021,492.460	
KRAFT HEINZ CO	87,780	42.330	3,715,727.400	
NOVOCURE LTD	10,423	93.030	969,651.690	
FORTIVE CORP	42,608	66.120	2,817,240.960	
WASTE CONNECTIONS INC	31,039	131.200	4,072,316.800	
ALPHABET INC-CL A	730,399	88.420	64,581,879.580	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	156,384	17.060	2,667,911.040	
PAYPAL HOLDINGS INC	133,121	77.920	10,372,788.320	
SEA LTD ADR	43,908	54.210	2,380,252.680	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	29.900	1,343,227.600	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	40.860	666,876.060	
ALPHABET INC-CL C	678,721	89.240	60,569,062.040	
ZSCALER INC	10,310	104.970	1,082,240.700	
LINDE PLC	60,875	322.030	19,603,576.250	
ROKU INC	15,660	47.120	737,899.200	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,085	374.640	5,276,804.400	
VISTRA CORP	41,133	22.400	921,379.200	
アメリカ・ドル 小計	41,434,095		4,119,765,053.530 (545,456,893,086)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	45,963	17.545	806,420.830	
ASHTED GROUP	54,304	50.640	2,749,954.560	
SEVERN TRENT PLC	29,397	27.330	803,420.010	
BARCLAYS PLC	2,022,417	1.716	3,470,467.570	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.236	526,094.250	
BT GROUP PLC	756,852	1.251	946,821.850	
BUNZL PLC	38,593	29.330	1,131,932.690	
AVIVA PLC	348,683	4.584	1,598,362.870	
CRODA INTERNATIONAL	16,782	67.740	1,136,812.680	
DIAGEO PLC	278,619	36.315	10,118,048.980	

SCHRODERS PLC	110,366	4.529	499,847.610
DCC PLC	11,135	42.870	477,357.450
NATIONAL GRID PLC	436,527	10.225	4,463,488.570
KINGFISHER PLC	225,392	2.505	564,606.960
BAE SYSTEMS PLC	379,623	8.394	3,186,555.460
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	262,877	31.535	8,289,826.190
HALMA PLC	41,997	20.900	877,737.300
NEXT PLC	18,751	62.660	1,174,937.660
IMPERIAL BRANDS PLC	107,889	20.520	2,213,882.280
JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	21.880	437,074.880
ANGLO AMERICAN PLC	157,426	34.935	5,499,677.310
COMPASS GROUP PLC	212,418	19.175	4,073,115.150
HSBC HOLDINGS PLC	2,445,384	5.641	13,794,411.140
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	738,179	2.583	1,906,716.350
UNILEVER PLC	307,132	41.980	12,893,401.360
UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.250	928,332.250
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	17.545	743,048.290
PEARSON PLC	84,159	9.160	770,896.440
PERSIMMON PLC	35,252	12.790	450,873.080
PRUDENTIAL PLC	333,971	12.410	4,144,580.110
RIO TINTO PLC	137,792	60.730	8,368,108.160
VODAFONE GROUP PLC	3,220,482	0.877	2,824,362.710
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	88,653	59.020	5,232,300.060
RELX PLC	229,145	23.420	5,366,575.900
RENTOKIL INITIAL PLC	312,114	5.110	1,594,902.540
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	1.010	1,133,143.240
NATWEST GROUP PLC	670,464	2.754	1,846,457.850
ST JAMES' S PLACE PLC	67,448	11.500	775,652.000
SSE PLC	131,574	16.740	2,202,548.760
BP PLC	2,266,380	4.751	10,767,571.380
SAGE GROUP PLC (THE)	128,893	7.776	1,002,271.960
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.280	841,594.600
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	110.750	989,662.000
STANDARD CHARTERED PLC	294,895	6.878	2,028,287.810
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,477,863	0.480	4,069,374.240
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.062	605,194.500
TESCO PLC	934,247	2.421	2,261,811.980
3I GROUP PLC	107,283	13.990	1,500,889.170
SMITH & NEPHEW PLC	107,679	11.825	1,273,304.170
GSK PLC	499,550	14.140	7,063,637.000
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	39,268	72.800	2,858,710.400
WPP PLC	142,785	8.806	1,257,364.710
ASTRAZENECA PLC	189,322	118.020	22,343,782.440

	WHITBREAD PLC	25,470	28.400	723,348.000	
	INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.450	989,467.050	
	BURBERRY GROUP PLC	52,229	22.380	1,168,885.020	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	51.940	1,129,798.880	
	SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.458	472,174.420	
	ADMIRAL GROUP PLC	21,325	22.720	484,504.000	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	40.960	465,305.600	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	16.730	308,752.150	
	AVEVA GROUP PLC	11,702	32.170	376,453.340	
	ABRDN PLC	285,831	1.966	561,943.740	
	EXPERIAN PLC	112,709	28.820	3,248,273.380	
	MONDI PLC	58,887	14.720	866,816.640	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.784	324,498.520	
	OCADO GROUP PLC	69,766	7.204	502,594.260	
	INFORMA PLC	186,195	6.434	1,197,978.630	
	GLENCORE PLC	1,187,922	5.341	6,344,691.400	
	ENTAIN PLC	74,451	14.585	1,085,867.830	
	COCA-COLA HBC AG	21,338	19.550	417,157.900	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	6.240	538,031.520	
	M&G PLC	270,401	1.965	531,337.960	
	JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.409	355,321.620	
	HALEON PLC	622,766	3.125	1,946,143.750	
	SHELL PLC	889,720	23.765	21,144,195.800	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.498	609,359.830	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.464	713,271.040	
イギリス・ポンド 小計		34,706,505		225,392,381.990 (36,285,919,577)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	32.240	4,729,704.720	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	29.720	5,359,793.960	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	5.920	1,703,616.160	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	589.000	1,503,717.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	152.700	1,920,049.800	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.260	2,975,357.440	
	ICL GROUP LTD	103,067	26.000	2,679,742.000	
	NICE LTD	7,640	672.000	5,134,080.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	114.000	1,988,160.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	227.000	1,060,544.000	
イスラエル・シュケル 小計		925,709		29,054,765.080 (1,110,394,673)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	66.420	1,444,900.680	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	423,771	23.410	9,920,479.110	
	FORTESCUE METALS GROUP	210,104	21.770	4,573,964.080	

LTD				
TELSTRA GROUP LTD	482,855	3.960	1,912,105.800	
ASX LTD	23,664	66.280	1,568,449.920	
BHP GROUP LTD	619,881	47.800	29,630,311.800	
AMPOL LTD	31,828	27.470	874,315.160	
COMPUTERSHARE LT	72,081	24.210	1,745,081.010	
CSL LIMITED	58,245	275.630	16,054,069.350	
REA GROUP LTD	6,134	112.830	692,099.220	
TRANSURBAN GROUP	379,633	13.250	5,030,137.250	
COCHLEAR LTD	7,836	208.050	1,630,279.800	
ORIGIN ENERGY LTD	213,229	7.690	1,639,731.010	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	205,033	103.320	21,184,009.560	
RIO TINTO LIMITED	45,936	118.230	5,431,013.280	
APA GROUP	164,300	10.440	1,715,292.000	
ARISTOCRAT LEISU	76,675	32.060	2,458,200.500	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.630	1,304,104.320	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	28.720	1,745,228.240	
IGO LTD	91,947	13.910	1,278,982.770	
ORICA LTD	43,659	14.870	649,209.330	
LEND LEASE CORP LTD	65,475	8.030	525,764.250	
BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	17.690	890,249.250	
MACQUARIE GROUP LTD	46,642	173.520	8,093,319.840	
SUNCORP GROUP LTD	154,162	11.820	1,822,194.840	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	392,866	29.930	11,758,479.380	
NEWCREST MINING LTD	112,815	22.270	2,512,390.050	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.330	713,131.470	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	12.770	2,202,658.990	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	11.730	1,590,329.940	
REECE LTD	31,558	14.390	454,119.620	
SANTOS LTD	417,358	7.050	2,942,373.900	
SONIC HEALTHCARE	52,774	30.460	1,607,496.040	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	27.780	721,863.300	
WESFARMERS LTD	139,720	46.970	6,562,648.400	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	235,431	35.010	8,242,439.310	
WOOLWORTHS GROUP LTD	145,725	33.630	4,900,731.750	
SEEK LTD	38,405	21.260	816,490.300	
MINERAL RESOURCES LTD	21,179	84.750	1,794,920.250	
BRAMBLES LTD	170,929	11.500	1,965,683.500	
PILBARA MINERALS LTD	327,947	3.870	1,269,154.890	
AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.700	824,541.300	
TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	13.380	1,060,137.540	

	XERO LTD	14,590	71.640	1,045,227.600	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	29.500	701,539.500	
	LOTTERY CORP LTD	227,460	4.720	1,073,611.200	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.300	1,010,961.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	355,854	23.720	8,440,856.880	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	2.880	859,898.880	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	4.450	2,655,288.300	
	COLES GROUP LTD	151,233	16.580	2,507,443.140	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	50.520	748,857.960	
	オーストラリア・ドル 小計	8,516,579		194,796,766.760 (17,790,788,708)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	52,200	74.170	3,871,674.000	
	BARRICK GOLD CORP	214,835	26.060	5,598,600.100	
	BANK OF MONTREAL	82,585	127.650	10,541,975.250	
	BANK OF NOVA SCOTIA	144,527	67.610	9,771,470.470	
	NATIONAL BANK OF CANADA	40,967	95.250	3,902,106.750	
	BCE INC	7,697	61.450	472,980.650	
	BROOKFIELD CORP	170,004	45.220	7,687,580.880	
	SAPUTO INC	26,668	35.160	937,646.880	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	9.700	895,416.700	
	DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	11,508	95.150	1,094,986.200	
	CGI INC	25,261	114.530	2,893,142.330	
	CCL INDUSTRIES INC	16,363	59.540	974,253.020	
	CAE INC	40,808	27.460	1,120,587.680	
	CAMECO CORP	54,264	33.990	1,844,433.360	
	ROGERS COMM-CL B	45,607	63.390	2,891,027.730	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	109,348	56.930	6,225,181.640	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	136,276	74.370	10,134,846.120	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	152.000	930,848.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	36.920	602,903.600	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	70,975	163.140	11,578,861.500	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.140	849,846.820	
	OPEN TEXT CORP	33,217	41.570	1,380,830.690	
	EMPIRE CO LTD	29,433	36.060	1,061,353.980	
	KINROSS GOLD CORP	219,914	6.200	1,363,466.800	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	79.520	1,056,502.720	
	FORTIS INC	60,484	55.280	3,343,555.520	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	74,203	30.940	2,295,840.820	
	TELUS CORP	31,890	26.990	860,711.100	
	GREAT WEST LIFE CO INC	34,208	33.400	1,142,547.200	
	IMPERIAL OIL LTD	27,246	64.180	1,748,648.280	
	ENBRIDGE INC	244,225	55.040	13,442,144.000	
	IGM FINANCIAL INC	12,478	40.080	500,118.240	

MANULIFE FINANCIAL CORP	233,861	24.770	5,792,736.970
LOBLAW CO LTD	21,600	119.090	2,572,344.000
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	101,210	62.570	6,332,709.700
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	82.000	2,650,896.000
SUN LIFE FINANCIAL INC	75,884	62.940	4,776,138.960
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,799	817.430	2,287,986.570
METRO INC	28,629	74.180	2,123,699.220
EMERA INC	30,947	52.000	1,609,244.000
ONEX CORP	10,157	64.730	657,462.610
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	24.280	469,162.440
POWER CORP OF CANADA	65,500	34.210	2,240,755.000
QUEBECOR INC-B	17,195	31.750	545,941.250
ROYAL BANK OF CANADA	169,273	132.900	22,496,381.700
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	113,049	102.640	11,603,349.360
SHAW COMM INC-B	59,877	38.650	2,314,246.050
SUNCOR ENERGY INC	165,224	41.660	6,883,231.840
LUNDIN MINING CORP	68,762	9.630	662,178.060
TECK RESOURCES LTD-CL B	57,326	53.090	3,043,437.340
THOMSON REUTERS CORP	19,979	155.400	3,104,736.600
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	101.950	985,346.750
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	221,445	86.000	19,044,270.000
TC ENERGY CORP	123,753	54.770	6,777,951.810
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	97.520	790,107.040
WESTON (GEORGE) LTD	8,379	173.190	1,451,159.010
INTACT FINANCIAL CORP	21,566	199.190	4,295,731.540
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,414	58.360	3,117,241.040
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,530	2,242.560	5,673,676.800
FRANCO-NEVADA CORP NPR	23,163	193.340	4,478,334.420
TOURMALINE OIL CORP	39,298	63.190	2,483,240.620
KEYERA CORP	24,571	29.700	729,758.700
PARKLAND CORP	15,665	30.680	480,602.200
ALTAGAS LTD	33,833	23.470	794,060.510
PEMBINA PIPELINE CORP	68,179	46.480	3,168,959.920
DOLLARAMA INC	32,535	81.370	2,647,372.950
CENOVUS ENERGY INC W/I	167,715	25.160	4,219,709.400
ARC RESOURCES LTD	74,961	15.830	1,186,632.630
NORTHLAND POWER INC	34,152	37.830	1,291,970.160
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	18.700	958,244.100
TMX GROUP LTD	7,040	137.960	971,238.400
BRP INC	4,307	105.910	456,154.370
IVANHOE MINES LTD	64,027	12.040	770,885.080
NUTRIEN LTD	66,177	99.800	6,604,464.600

	TFI INTERNATIONAL INC	9,399	141.600	1,330,898.400	
	WSP GLOBAL INC	15,681	166.900	2,617,158.900	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,011	80.190	963,162.090	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	40.990	1,130,381.230	
	NUVEI CORP	7,929	40.700	322,710.300	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	38.630	622,058.890	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	42,501	40.630	1,726,815.630	
	AIR CANADA	18,814	20.790	391,143.060	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	35,384	88.560	3,133,607.040	
	SHOPIFY INC	146,823	49.010	7,195,795.230	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	179.100	937,946.700	
	HYDRO ONE LTD	37,626	35.950	1,352,654.700	
カナダ・ドル 小計		4,990,683		290,284,170.920 (28,619,116,411)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.410	491,722.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	211,910	34.560	7,323,609.600	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.680	302,592.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	28.510	441,905.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	8.970	895,206.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.980	745,969.140	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	7.270	1,344,223.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	398,198	12.540	4,993,402.920	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.470	2,330,025.100	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.580	907,866.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	139,966	30.100	4,212,976.600	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.650	289,940.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	17.580	770,004.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	4.130	1,067,605.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.730	1,143,580.700	
シンガポール・ドル 小計		3,753,587		27,260,627.060 (2,710,796,755)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	451,599	3.058	1,380,989.740	
	LOGITECH INTL-REG	23,734	61.360	1,456,318.240	
	NESTLE SA-REGISTERED	335,501	111.380	37,368,101.380	
	CIE FINANC RICHEMONT	64,458	134.950	8,698,607.100	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	85,335	292.550	24,964,754.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,236	186.800	978,084.800	
	SIKA INHABER	17,793	240.400	4,277,437.200	
	SGS SA-REG	748	2,264.000	1,693,472.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	263,600	83.520	22,015,872.000	

	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	149.000	845,575.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,828.000	840,880.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	15.290	322,190.880	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	528.400	1,812,940.400	
	ABB LTD	194,538	30.240	5,882,829.120	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	32.010	635,142.420	
	GEBERIT AG	4,377	495.800	2,170,116.600	
	LONZA GROUP AG-REG	9,027	470.500	4,247,203.500	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	9,500.000	1,111,500.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	95,800.000	1,245,400.000	
	GIVAUDAN-REG	1,105	3,008.000	3,323,840.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18,153	449.100	8,152,512.300	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,612	353.200	1,275,758.400	
	HOLCIM LTD	66,607	50.640	3,372,978.480	
	TEMENOS GROUP	7,082	55.980	396,450.360	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	82.550	385,756.150	
	SONOVA HOLDING AG	6,135	228.500	1,401,847.500	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,887	218.400	1,504,120.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,969	115.850	1,502,458.650	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	291.900	913,647.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	53.150	492,115.850	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	175.400	477,088.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	508.400	1,835,324.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	87.800	430,483.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	660.000	534,600.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	83.100	695,713.200	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,852	862.400	2,459,564.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	56.780	1,478,040.180	
	SWISS RE LTD	36,229	92.860	3,364,224.940	
	BKW AG	3,194	131.700	420,649.800	
	SIG GROUP AG	38,322	22.100	846,916.200	
	ALCON INC	61,285	66.720	4,088,935.200	
	UBS GROUP AG	403,341	18.545	7,479,958.840	
	VAT GROUP AG	3,325	279.000	927,675.000	
スイス・フラン	小計	2,241,162		169,708,073.680 (24,373,473,542)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	334,122	131.580	43,963,772.760	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	194,204	116.900	22,702,447.600	
	ERICSSON LM-B SHS	366,551	63.390	23,235,667.890	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	218.700	5,632,618.500	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	200.600	11,722,462.200	
	LUNDBERGS B	7,859	462.300	3,633,215.700	
	SKF AB-B SHS	46,594	179.650	8,370,612.100	
	SANDVIK AB	133,350	203.000	27,070,050.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	195,837	125.850	24,646,086.450	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	175.300	7,702,156.100	

	SWEDBANK AB	112,296	190.100	21,347,469.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	142.200	9,984,004.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	184,499	110.150	20,322,564.850	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	205.800	4,979,948.400	
	VOLVO AB-B SHS	179,832	195.080	35,081,626.560	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	429.400	4,354,974.800	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	90.960	5,859,279.360	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	266.700	4,078,376.400	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	266.000	5,672,450.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	159.380	4,288,437.660	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	92.680	7,051,557.800	
	INVESTOR AB-B SHS	226,392	197.420	44,694,308.640	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	127.640	10,503,112.680	
	ASSA ABLOY AB-B	124,612	236.400	29,458,276.800	
	TELIA CO AB	344,810	27.640	9,530,548.400	
	BOLIDEN AB	36,260	431.700	15,653,442.000	
	ALFA LAVAL AB	35,313	323.900	11,437,880.700	
	KINNEVIK AB-B	36,278	155.600	5,644,856.800	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	53.700	3,916,985.400	
	INDUTRADE AB	29,769	228.500	6,802,216.500	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	79.700	3,807,189.300	
	NIBE INDUSTRIER AB	185,845	104.150	19,355,756.750	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	223.500	4,107,930.000	
	HEXAGON AB-B SHS	248,163	116.200	28,836,540.600	
	SAGAX AB	19,038	262.300	4,993,667.400	
	EPIROC AB-A	84,563	207.200	17,521,453.600	
	EPIROC AB-B	41,205	177.800	7,326,249.000	
	ESSITY AB-B	75,180	288.800	21,711,984.000	
	EQT AB	31,718	245.400	7,783,597.200	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	47.890	3,821,190.990	
	VOLVO CAR AB	63,710	49.540	3,156,193.400	
	LIFCO AB	26,835	184.750	4,957,766.250	
	EVOLUTION AB	22,326	1,129.600	25,219,449.600	
	NORDEA BANK ABP	403,793	119.560	48,277,491.080	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	208.500	3,239,881.500	
	スウェーデン・クローナ 小計	4,544,367		643,457,747.520 (8,184,782,548)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,549	927.600	11,640,452.400	
	A P MOLLER A/S	663	15,060.000	9,984,780.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	14,850.000	5,331,150.000	
	DANSKE BANK A/S	85,371	142.450	12,161,098.950	
	GENMAB A/S	7,926	2,999.000	23,770,074.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	354.200	8,450,857.800	
	ROCKWOOL AS	873	1,787.000	1,560,051.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	202,240	930.700	188,224,768.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	125,436	198.700	24,924,133.200	

	COLOPLAST-B	15,343	841.000	12,903,463.000	
	DSV A/S	22,074	1,087.000	23,994,438.000	
	DEMANT A/S	11,367	199.150	2,263,738.050	
	TRYG A/S	44,887	158.950	7,134,788.650	
	PANDORA A/S	9,912	539.000	5,342,568.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	503.600	6,314,136.800	
	ORSTED A/S	23,240	640.600	14,887,544.000	
デンマーク・クローネ 小計		598,637		358,888,041.850 (6,865,528,241)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.090	1,329,518.690	
	FISHER & PAYKEL	78,460	23.380	1,834,394.800	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.300	1,160,901.400	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.650	355,012.100	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	5.380	711,004.660	
ニュージーランド・ドル 小計		656,830		5,390,831.650 (454,824,466)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	173.750	7,906,320.000	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	75.060	12,232,603.260	
	TELENOR ASA	85,954	99.380	8,542,108.520	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	392.200	4,386,757.000	
	ORKLA ASA	116,068	72.880	8,459,035.840	
	EQUINOR ASA	115,617	309.100	35,737,214.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	455.600	9,036,370.400	
	AKER BP ASA	38,723	304.900	11,806,642.700	
	SALMAR ASA	7,248	398.000	2,884,704.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	186.700	4,802,110.700	
	ADEVINTA ASA	24,382	70.850	1,727,464.700	
	DNB BANK ASA	119,319	193.400	23,076,294.600	
ノルウェー・クローネ 小計		772,526		130,597,626.420 (1,734,336,479)	
ユーロ	CRH PLC	90,748	40.365	3,663,043.020	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	140.700	2,807,387.100	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	86.420	1,578,720.560	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	55.920	975,859.920	
	UMICORE	24,290	35.370	859,137.300	
	AIR LIQUIDE	63,347	141.700	8,976,269.900	
	AIRBUS SE	73,377	115.100	8,445,692.700	
	AXA SA	228,092	27.450	6,261,125.400	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	83,720	26.470	2,216,068.400	
	ADIDAS AG	20,476	140.100	2,868,687.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	133,912	17.330	2,320,694.960	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	151.300	472,056.000	
	DANONE	79,150	49.490	3,917,133.500	
	SAFRAN SA	40,925	121.840	4,986,302.000	
	INTESA SANPAOLO	2,050,973	2.250	4,614,689.250	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	39,262	90.520	3,553,996.240	
ACCOR SA	18,305	26.420	483,618.100	
BOUYGUES	29,123	30.460	887,086.580	
BNP PARIBAS	133,053	58.350	7,763,642.550	
THALES SA	12,886	115.600	1,489,621.600	
CAPGEMINI SA	19,839	163.600	3,245,660.400	
UNICREDIT SPA	241,149	14.598	3,520,293.100	
D' IETEREN TRDG	2,736	175.500	480,168.000	
KONINKLIJKE DSM NV	20,425	119.950	2,449,978.750	
COMMERZBANK AG	141,036	9.430	1,329,969.480	
EIFFAGE	8,993	95.260	856,673.180	
FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	27.510	1,346,559.480	
UNITED INTERNET	10,010	21.000	210,210.000	
PUBLICIS GROUPE	26,472	61.360	1,624,321.920	
IBERDROLA SA	730,877	10.795	7,889,817.210	
ENI SPA	296,020	13.974	4,136,583.480	
JERONIMO MARTINS	34,644	21.360	739,995.840	
KESKO OYJ-B	35,252	21.250	749,105.000	
KBC GROUPE	32,213	63.920	2,059,054.960	
HANNOVER RUECK SE	7,105	185.800	1,320,109.000	
WARTSILA OYJ	50,956	8.460	431,087.760	
L' OREAL	29,178	364.350	10,631,004.300	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	33,871	756.300	25,616,637.300	
GEA GROUP AG	17,490	40.230	703,622.700	
BOLLORE	114,808	5.335	612,500.680	
MEDIOBANCA SPA	86,792	9.408	816,539.130	
MICHELIN (CGDE) -B	86,908	28.710	2,495,128.680	
CONTINENTAL AG	12,921	63.960	826,427.160	
DEUTSCHE POST AG-REG	118,731	37.605	4,464,879.250	
OMV AG	17,258	47.330	816,821.140	
VERBUND AG	7,320	73.150	535,458.000	
PERNOD-RICARD	24,888	187.500	4,666,500.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	16,854	56.800	957,307.200	
RENAULT SA	27,902	36.365	1,014,656.230	
REPSOL SA	178,713	14.790	2,643,165.270	
REMY COINTREAU	2,866	163.900	469,737.400	
MERCK KGAA	15,234	192.500	2,932,545.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	61,460	51.720	3,178,711.200	
RWE AG	77,853	39.450	3,071,300.850	
SEB SA	2,596	90.200	234,159.200	
SOCIETE GENERALE-A	100,409	24.550	2,465,040.950	
VINCI S. A.	66,767	99.400	6,636,639.800	
SODEXO	9,822	88.100	865,318.200	
SOFINA	1,449	217.200	314,722.800	
SOLVAY SA	9,070	101.400	919,698.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	66,119	144.280	9,539,649.320	

VIVENDI SE	76,073	9.412	715,999.070
SAP SE	126,307	104.680	13,221,816.760
TELEFONICA S. A	614,947	3.568	2,194,130.890
TOTALENERGIES SE	303,774	58.410	17,743,439.340
VALEO	26,570	18.985	504,431.450
E. ON SE	280,287	9.882	2,769,796.130
VOEST-ALPINE AG	10,593	27.280	288,977.040
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	61.050	816,604.800
SIEMENS AG-REG	92,954	138.140	12,840,665.560
UPM-KYMMENE OYJ	62,233	34.790	2,165,086.070
ING GROEP NV-CVA	454,638	12.188	5,541,127.940
PUMA AG	16,210	62.000	1,005,020.000
BAYER AG	121,329	53.960	6,546,912.840
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	13.990	1,048,690.400
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	64.860	1,274,109.840
MERCEDES-BENZ GROUP AG	99,529	67.750	6,743,089.750
BASF SE	110,117	51.700	5,693,048.900
BEIERSDORF AG	12,940	109.450	1,416,283.000
HEIDELBERGCEMENT AG	20,809	57.820	1,203,176.380
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	33.020	787,692.100
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	274.400	1,423,587.200
ORANGE	255,481	9.892	2,527,218.050
SAMPO OYJ-A SHS	58,396	48.780	2,848,556.880
RANDSTAD NV	15,584	56.300	877,379.200
ALLIANZ SE	49,878	216.300	10,788,611.400
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.781	1,520,147.630
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	125,884	27.355	3,443,556.820
HERMES INTL	3,916	1,606.500	6,291,054.000
ENDESA S. A.	37,701	18.710	705,385.710
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	8.365	605,140.830
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	31.980	1,461,038.280
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	16,705	321.800	5,375,669.000
ARCELOR MITTAL (NL)	66,878	27.205	1,819,415.990
DASSAULT SYSTEMES SA	81,900	34.390	2,816,541.000
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	28.220	665,173.620
RHEINMETALL STAMM	4,693	211.600	993,038.800
HEINEKEN NV	32,026	90.220	2,889,385.720
AKZO NOBEL	22,627	66.260	1,499,265.020
ASML HOLDING NV	49,677	582.700	28,946,787.900
AEGON NV	196,332	4.944	970,665.400
VOLKSWAGEN AG	3,315	159.250	527,913.750
VOLKSWAGEN AG PFD	22,269	127.280	2,834,398.320
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	735,118	6.310	4,638,594.580
KERING	8,881	524.300	4,656,308.300

ACCIONA S. A.	2, 642	180. 300	476, 352. 600
FORTUM OYJ	54, 194	14. 745	799, 090. 530
AGEAS	18, 136	44. 190	801, 429. 840
UCB SA	16, 732	77. 840	1, 302, 418. 880
NEMETSCHEK SE	9, 878	50. 900	502, 790. 200
CARREFOUR SA	75, 572	16. 825	1, 271, 498. 900
NATURGY ENERGY GROUP SA	17, 677	25. 540	451, 470. 580
NOKIA OYJ	637, 662	4. 557	2, 905, 825. 730
KONINKLIJKE PHILIPS NV	115, 512	15. 372	1, 775, 650. 460
WOLTERS KLUWER-CVA	32, 047	98. 080	3, 143, 169. 760
SANOFI	137, 939	90. 070	12, 424, 165. 730
STMICROELECTRONICS NV	80, 161	37. 120	2, 975, 576. 320
ELISA OYJ	20, 242	51. 240	1, 037, 200. 080
BANCO SANTANDER SA	2, 066, 857	3. 036	6, 274, 977. 850
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49, 011	16. 415	804, 515. 560
QIAGEN N. V.	27, 412	47. 040	1, 289, 460. 480
DEUTSCHE BANK AG-REG	253, 716	11. 656	2, 957, 313. 690
BMW VORZUG	7, 821	84. 750	662, 829. 750
ENEL SPA	1, 019, 343	5. 536	5, 643, 082. 840
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	393, 301	19. 970	7, 854, 220. 970
SARTORIUS AG	2, 847	389. 700	1, 109, 475. 900
UBISOFT ENTERTAINMENT	11, 032	23. 810	262, 671. 920
INFINEON TECHNOLOGIES AG	159, 023	30. 820	4, 901, 088. 860
RATIONAL AG	516	606. 000	312, 696. 000
CARL ZEISS MEDITEC AG	4, 866	128. 000	622, 848. 000
BECHTLE AG	8, 139	35. 100	285, 678. 900
KONINKLIJKE KPN NV	475, 739	3. 004	1, 429, 119. 950
EUROFINS SCIENTIFIC	14, 779	66. 620	984, 576. 980
TELEPERFORMANCE	7, 845	236. 100	1, 852, 204. 500
DEUTSCHE BOERSE AG	22, 570	162. 800	3, 674, 396. 000
EURAZEO	5, 673	61. 450	348, 605. 850
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11, 318	76. 700	868, 090. 600
HEINEKEN HOLDING NV-A	10, 853	72. 600	787, 927. 800
INDITEX	136, 321	26. 740	3, 645, 223. 540
ESSILORLUXOTTICA	35, 682	172. 650	6, 160, 497. 300
SNAM SPA	256, 415	4. 828	1, 237, 971. 620
CREDIT AGRICOLE SA	143, 720	10. 476	1, 505, 610. 720
ENAGAS	38, 270	16. 040	613, 850. 800
WENDEL	5, 449	93. 100	507, 301. 900
TENARIS SA	55, 855	15. 845	885, 022. 470
TELECOM ITALIA SPA	908, 286	0. 249	226, 163. 210
TERNA SPA	166, 064	7. 254	1, 204, 628. 250
BIOMERIEUX	4, 870	99. 160	482, 909. 200
GRIFOLS SA	31, 982	11. 675	373, 389. 850
FERROVIAL SA	56, 362	25. 750	1, 451, 321. 500
NESTE OYJ	50, 599	44. 370	2, 245, 077. 630
RECORDATI SPA	10, 908	39. 040	425, 848. 320
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57, 775	9. 862	569, 777. 050

MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	216.800	1,581,339.200
KONE OYJ	43,814	50.640	2,218,740.960
ELIA GROUP	4,078	137.700	561,540.600
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	294.200	914,667.800
ENGIE	221,751	13.156	2,917,356.150
ALSTOM	37,007	24.750	915,923.250
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	12.000	780,144.000
IPSEN SA	3,873	104.700	405,503.100
ARKEMA SA	6,392	88.760	567,353.920
LEGRAND SA	32,783	79.360	2,601,658.880
AMPLIFON SPA	12,300	28.010	344,523.000
ADP	3,975	132.350	526,091.250
ORION OYJ	13,559	53.940	731,372.460
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	12.545	745,248.270
SYMRISE AG	17,265	105.750	1,825,773.750
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	37.940	1,230,090.680
PRYSMIAN SPA	30,728	34.570	1,062,266.960
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	126.200	306,539.800
CAIXABANK	566,059	3.887	2,200,271.330
BUREAU VERITAS SA	31,295	26.010	813,982.950
GETLINK	63,509	14.950	949,459.550
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	20.770	824,319.760
AMADEUS IT GROUP SA	54,712	54.560	2,985,086.720
BRENTAG SE	17,934	65.580	1,176,111.720
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	19.300	476,459.100
EDENRED	31,091	48.310	1,502,006.210
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.561	270,118.910
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	68.540	562,644.860
VONOVIA SE	85,937	25.210	2,166,471.770
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	9.554	1,285,366.490
KNORR-BREMSE AG	10,342	58.700	607,075.400
OCI NV	12,329	32.200	396,993.800
SIEMENS HEALTHINEERS AG	34,318	47.500	1,630,105.000
FERRARI NV	15,435	213.500	3,295,372.500
CNH INDUSTRIAL NV	124,604	15.615	1,945,691.460
AROUNDTOWN SA	113,225	2.608	295,290.800
AIB GROUP PLC	147,578	3.870	571,126.860
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	39.720	686,877.960
MONCLER SPA	25,014	51.900	1,298,226.600
NEXI SPA	58,847	7.836	461,125.090
PROSUS NV	102,526	74.370	7,624,858.620
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	101.100	1,534,091.400
JDE PEET'S BV	14,385	27.440	394,724.400
EXOR NV	14,142	72.300	1,022,466.600
SIEMENS ENERGY AG	59,014	17.665	1,042,482.310

EURONEXT NV	10,081	71.240	718,170.440	
IMCD NV	6,823	141.700	966,819.100	
WORLDLINE SA	29,916	40.120	1,200,229.920	
NN GROUP NV	31,214	39.210	1,223,900.940	
FINECOBANK SPA	75,180	16.830	1,265,279.400	
ARGENX SE	6,753	354.600	2,394,613.800	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	92,502	23.595	2,182,584.690	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	56,693	30.100	1,706,459.300	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	36.040	353,984.880	
IBERDROLA SA-RTS	730,877	0.178	130,096.100	
ZALANDO SE	31,321	38.990	1,221,205.790	
STELLANTIS NV	262,624	14.666	3,851,643.580	
AENA SME SA	8,494	127.700	1,084,683.800	
CELLNEX TELECOM SAU	64,293	32.600	2,095,951.800	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	22.990	521,183.300	
ABN AMRO BANK NV	52,835	14.605	771,655.170	
SCOUT24 SE	10,048	49.770	500,088.960	
COVESTRO AG	27,558	41.800	1,151,924.400	
HELLOFRESH SE	17,856	24.940	445,328.640	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	105,327	56.340	5,934,123.180	
POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.700	571,223.300	
AMUNDI SA	6,292	57.550	362,104.600	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.798	410,330.440	
ADYEN NV	2,593	1,340.000	3,474,620.000	
DELIVERY HERO SE	22,564	47.850	1,079,687.400	
ユーロ 小計	22,926,806		552,803,372.160 (78,636,279,690)	
香港・ドル				
HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	15.060	3,870,420.000	
CLP HOLDINGS LTD	197,296	57.600	11,364,249.600	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	42.250	3,942,516.500	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	145,391	373.800	54,347,155.800	
MTR CORP	192,441	41.600	8,005,545.600	
HANG SENG BANK LTD	95,096	128.900	12,257,874.400	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	28.000	4,787,216.000	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	42.900	6,491,628.000	
HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	7.690	11,814,962.140	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	53.500	13,958,364.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	27.550	11,570,862.250	
NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	22.550	3,902,638.300	
SINO LAND CO	411,200	10.100	4,153,120.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	180,565	108.600	19,609,359.000	

SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	67.250	3,565,595.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	180,156	94.550	17,033,749.800	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	16.580	2,951,240.000	
AIA GROUP LTD	1,454,316	86.350	125,580,186.600	
HKT TRUST / HKT LTD	463,136	9.840	4,557,258.240	
SANDS CHINA LTD	335,800	29.350	9,855,730.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	18.060	2,528,400.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	21.300	4,294,080.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	45.900	9,002,596.500	
ESR GROUP LTD	216,400	16.000	3,462,400.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	5.090	1,254,685.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	26.350	6,982,750.000	
WH GROUP LTD	931,500	4.880	4,545,720.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	48.800	15,149,716.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	49.650	13,216,581.750	
香港・ドル 小計	9,723,169		394,056,600.480 (6,679,259,378)	
合計	135,790,655		758,902,393,554 (758,902,393,554)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,284,033.870	
		GOODMAN GROUP	214,602.000	3,828,499.680	
		GPT GROUP	219,223.000	940,466.670	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	939,180.340	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,863,927.360	
		STOCKLAND	259,328.000	949,140.480	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	765,396.720	
	オーストラリア・ドル 小計		2,323,705.000	10,570,645.120 (965,417,017)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,574,462.000	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,203,050.940	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	772,783.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	697,460.000	
	シンガポール・ドル 小計		2,107,509.000	4,247,755.940 (422,396,851)	
	投資信託受益証券 合計		4,431,214	1,387,813,868 (1,387,813,868)	

投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,835.000	2,781,176.100	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,304,956.380	
		AMERICAN TOWER CORP	56,451.000	12,529,299.450	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,311,414.390	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,932.000	2,759,746.680	
		BOSTON PROPERTIES INC	18,531.000	1,248,804.090	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,271.000	1,504,798.690	
		CROWN CASTLE INC	52,742.000	7,758,348.200	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	34,187.000	3,498,013.840	
		EQUINIX INC	11,088.000	7,707,823.200	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,341,628.140	
		EQUITY RESIDENTIAL	46,054.000	2,705,672.500	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,345.000	1,786,330.700	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	16,256.000	2,381,178.880	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,539,058.300	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	869,029.210	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,566.000	1,636,100.900	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,509,731.650	
		INVITATION HOMES INC	76,646.000	2,284,817.260	
		IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,731,222.240	
		KIMCO REALTY	71,517.000	1,457,516.460	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	903,364.230	
		MID AMERICA	13,578.000	2,100,788.160	
		PROLOGIS INC	111,846.000	12,979,728.300	
		PUBLIC STORAGE	19,317.000	5,431,554.060	
		REALTY INCOME CORP	76,685.000	4,918,575.900	
		REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,197,861.330	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	12,918.000	3,795,695.940	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	39,034.000	4,561,122.900	
		SUN COMMUNITIES INC	14,694.000	2,112,262.500	
		UDR INC	41,516.000	1,602,102.440	
		VENTAS INC	48,092.000	2,298,316.680	
		VICI PROPERTIES INC	114,690.000	3,713,662.200	
WELLTOWER INC	58,944.000	4,066,546.560			
WEYERHAEUSER CO	89,893.000	2,774,097.980			
WP CAREY INC	23,664.000	1,901,639.040			
アメリカ・ドル	小計	1,580,343.000	116,003,985.480 (15,358,927,678)		
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	488,593.320		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	513,895.270		

	SEGRO PLC	139,569.000	1,103,990.790	
イギリス・ポンド	小計	335,772.000	2,106,479.380 (339,122,115)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	393,449.420	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	313,577.760	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	707,027.180 (69,705,810)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	296,107.700	
	GECINA SA	5,045.000	507,527.000	
	KLEPIERRE	25,279.000	556,138.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	715,730.800	
	WAREHOUSES DE PAUW	27,206.000	762,312.120	
ユーロ	小計	76,131.000	2,837,815.620 (403,679,272)	
香港・ドル	LINK REIT	262,516.000	15,737,834.200	
香港・ドル	小計	262,516.000	15,737,834.200 (266,756,290)	
投資証券	合計	2,277,908	16,438,191,165 (16,438,191,165)	
合計			17,826,005,033 (17,826,005,033)	

(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 601銘柄 投資証券 36銘柄	67.90 —	— —	— 1.91	72.20
イギリス・ポンド	株式 78銘柄 投資証券 3銘柄	4.52 —	— —	— 0.04	4.72
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.14	—	—	0.14
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄 投資信託受益証券 7銘柄	2.21 —	— 0.12	— —	2.41
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	3.56 —	— —	— 0.01	3.69
シンガポール・ドル	株式 15銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	0.34 —	— 0.05	— —	0.40
スイス・フラン	株式 43銘柄	3.03	—	—	3.14
スウェーデン・クローナ	株式 45銘柄	1.02	—	—	1.05
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.85	—	—	0.88
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.06	—	—	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.22	—	—	0.22
ユーロ	株式 223銘柄	9.79	—	—	10.18

	投資証券	5銘柄	—	—	0.05	
香港・ドル	株式	29銘柄	0.83	—	—	0.89
	投資証券	1銘柄	—	—	0.03	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	598,855,592
コール・ローン	447,863,642
国債証券	183,260,552,033
派生商品評価勘定	194,452
未収利息	1,092,379,589
前払費用	162,144,833
流動資産合計	185,561,990,141
資産合計	185,561,990,141
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	705,359
未払金	3,984,604,073
未払解約金	436,774,000
流動負債合計	4,422,083,432
負債合計	4,422,083,432
純資産の部	
元本等	
元本	90,161,381,348
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	90,978,525,361
元本等合計	181,139,906,709
純資産合計	181,139,906,709
負債純資産合計	185,561,990,141

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年1月12日
	至 2023年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
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. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	72,664,346,452円
同期中追加設定元本額	59,686,469,020円
同期中一部解約元本額	42,189,434,124円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,998,867,532円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	4,763,445円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	29,465,948円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	71,260,998円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	60,096,696円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	40,921,685円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	45,093,310円
たわらノーロード 先進国債券	16,468,978,025円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	236,946,771円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,332,111,921円
たわらノーロード バランス（堅実型）	63,907,819円
たわらノーロード バランス（標準型）	322,707,186円
たわらノーロード バランス（積極型）	67,946,157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）	13,123,789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）	596,489,405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）	822,180,597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）	313,556,462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）	214,111,017円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	2,006,928円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,282,152円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	173,477,312円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	14,270,510円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	23,513,045円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,629,794,544円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	806,521,306円

One グローバルバランス	11,412,208円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	732,558,815円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,319,739,613円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,562,975,814円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	418,020,315円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	840,738,943円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	725,908,949円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,015,594円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	508,877,587円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	36,330,259円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	146,595,885円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	150,866,647円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	229,942,536円
クルーズコントロール	155,908,387円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	180,603,325円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	576,899,281円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	612,720,890円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,820,147円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	300,172,955円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,053,505,619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)	442,371,608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)	453,267,711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)	111,015,667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)	275,675,518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)	435,092,303円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	941,278,253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)	163,793,956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)	392,835,435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)	213,539,627円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,402,900,023円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,607,596,617円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,556,225,047円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,283,700,038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)	74,771,877円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	49,222,893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)	750,441,772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)	361,185,468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)	235,486,976円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,076,528円

D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	33,985,564円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	7,458,867円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	49,876円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	14,623,479円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	43,562,916円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,662,754,177円
D I A Mバランスファンド3 7. 5 V A (適格機関投資家限定)	1,410,570,107円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,546,981,031円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	65,616,271円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	128,420,174円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	1,513,148,047円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	341,079,324円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	164,845円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	307,226,791円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	276,127,849円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	387,066,891円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	52,326,009円
動的パッケージファンド<DC年金>	54,565,376円
コア資産形成ファンド	36,293,828円
MHAM外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	720,918,617円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	305,355,414円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	7,052,612,220円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,311,988,029円
計	90,161,381,348円
2. 受益権の総数	90,161,381,348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 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの

運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	2023年1月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	△18,966,595,814	
合計	△18,966,595,814	

(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22日から2023年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	99,711,080	—	100,278,375	△567,295
ユーロ	30,448,110	—	30,580,334	△132,224
ユーロ	69,262,970	—	69,698,041	△435,071
買建	3,800,000,000	—	3,800,056,388	56,388
アメリカ・ドル	1,968,441,000	—	1,968,512,385	71,385
イギリス・ポンド	145,749,000	—	145,765,120	16,120
オーストラリア・ドル	58,803,000	—	58,809,698	6,698
オフショア・人民元	174,856,000	—	174,779,847	△76,153
カナダ・ドル	75,775,000	—	75,775,922	922
ポーランド・ズロチ	30,576,000	—	30,533,676	△42,324

メキシコ・ペソ	37,801,000	—	37,781,413	△19,587
ユーロ	1,307,999,000	—	1,308,098,327	99,327
合計	3,899,711,080	—	3,900,334,763	△510,907

(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。

①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。

②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)

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額	2.0091円
(1万口当たり純資産額)	(20,091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

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	1,660,000.000	1,585,689.040	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,800,000.000	4,569,374.970	
		US T N/B 0.25 03/15/24	3,910,000.000	3,714,805.440	
		US T N/B 0.25 05/15/24	7,500,000.000	7,077,246.070	
		US T N/B 0.25 05/31/25	3,890,000.000	3,549,625.000	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,555,857.780	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,192,109.370	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,452,062.500	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,251,193.750	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,366,164.050	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,605,000.000	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,321,039.040	
		US T N/B 0.375 04/15/24	4,140,000.000	3,925,560.910	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,351,200.000	
		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,761,406.240	
US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,246,517.940			

US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,844,710.910	
US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,870,781.240	
US T N/B 0.375 09/30/27	3,310,000.000	2,829,920.670	
US T N/B 0.375 11/30/25	3,190,000.000	2,877,230.450	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,702,929.680	
US T N/B 0.5 02/28/26	3,370,000.000	3,029,182.380	
US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,642,930.450	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,065,325.380	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,718,500.760	
US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,408,609.370	
US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,637,935.140	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,139,736.700	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,931,875.000	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,575,396.480	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,478,160.120	
US T N/B 0.625 08/15/30	6,340,000.000	5,107,167.130	
US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,751,250.000	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,360,398.410	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,320,000.000	2,855,200.000	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,780,316.370	
US T N/B 0.75 03/31/26	3,220,000.000	2,913,219.510	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,339,539.040	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,630,000.000	3,267,567.180	
US T N/B 0.75 08/31/26	2,950,000.000	2,638,290.980	
US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,446,467.180	
US T N/B 0.75 12/31/23	1,990,000.000	1,915,141.790	
US T N/B 0.875 01/31/24	200,000.000	192,195.310	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	2,987,275.000	
US T N/B 0.875 09/30/26	3,110,000.000	2,789,038.260	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,280,000.000	6,773,104.650	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,770,000.000	3,255,012.080	
US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,332,499.570	
US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,588,153.110	
US T N/B 1.125 02/15/31	7,890,000.000	6,575,821.860	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,795,146.870	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	989,355.460	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,860,000.000	3,390,919.520	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,145,257.790	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	2,040,421.850	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,238,251.940	
US T N/B 1.125 10/31/26	3,390,000.000	3,063,050.360	
US T N/B 1.25 03/31/28	3,610,000.000	3,185,683.950	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,010,000.000	3,532,716.000	
US T N/B 1.25 05/15/50	3,870,000.000	2,196,225.000	
US T N/B 1.25 05/31/28	3,300,000.000	2,901,164.030	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,257,264.060	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,130,000.000	6,746,629.670	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,727,172.630	
US T N/B 1.25 09/30/28	3,980,000.000	3,471,928.120	
US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,354,425.770	

US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,521,665.620
US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	708,222.640
US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,848,950.000
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,007,445.300
US T N/B 1.375 10/31/28	3,210,000.000	2,817,025.760
US T N/B 1.375 11/15/31	7,990,000.000	6,657,917.180
US T N/B 1.375 11/15/40	3,190,000.000	2,149,511.690
US T N/B 1.375 12/31/28	3,500,000.000	3,068,925.750
US T N/B 1.5 01/31/27	3,940,000.000	3,596,942.930
US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,301,882.810
US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,243,497.240
US T N/B 1.5 02/29/24	4,000,000.000	3,861,406.240
US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,431,162.870
US T N/B 1.5 09/30/24	4,310,000.000	4,106,790.220
US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,623,509.350
US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,530,625.000
US T N/B 1.625 02/15/26	2,890,000.000	2,694,247.640
US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,408,799.190
US T N/B 1.625 05/15/31	9,740,000.000	8,379,824.170
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,497,948.410
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,433,628.890
US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,577,475.000
US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	2,991,234.360
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,666,755.450
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	4,017,304.660
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,799,218.720
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,287,080.460
US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,909,467.180
US T N/B 1.75 08/15/41	4,930,000.000	3,500,300.000
US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,823,058.570
US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,896,951.930
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,950,925.760
US T N/B 1.875 02/15/32	7,280,000.000	6,311,987.490
US T N/B 1.875 02/15/41	4,700,000.000	3,447,706.980
US T N/B 1.875 02/15/51	4,920,000.000	3,282,178.080
US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,342,352.320
US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,600,312.480
US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,758,167.170
US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,867,421.860
US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	786,495.300
US T N/B 1.875 11/15/51	5,070,000.000	3,371,153.870
US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,949,714.040
US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,572,176.530
US T N/B 2.0 04/30/24	4,720,000.000	4,569,550.000
US T N/B 2.0 05/31/24	800,000.000	772,937.490
US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	279,600.770
US T N/B 2.0 08/15/25	5,050,000.000	4,794,738.250
US T N/B 2.0 08/15/51	5,110,000.000	3,509,931.250
US T N/B 2.0 11/15/26	2,830,000.000	2,642,623.030
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,149,316.370

US T N/B 2. 125 02/29/24	1, 650, 000. 000	1, 604, 496. 080	
US T N/B 2. 125 03/31/24	3, 340, 000. 000	3, 243, 714. 040	
US T N/B 2. 125 05/15/25	3, 950, 000. 000	3, 772, 558. 560	
US T N/B 2. 125 05/31/26	1, 550, 000. 000	1, 461, 117. 180	
US T N/B 2. 125 07/31/24	380, 000. 000	366, 640. 620	
US T N/B 2. 125 09/30/24	590, 000. 000	568, 197. 650	
US T N/B 2. 125 11/30/24	1, 780, 000. 000	1, 710, 190. 620	
US T N/B 2. 25 01/31/24	710, 000. 000	692, 277. 730	
US T N/B 2. 25 02/15/27	3, 780, 000. 000	3, 554, 971. 870	
US T N/B 2. 25 02/15/52	4, 300, 000. 000	3, 135, 976. 530	
US T N/B 2. 25 03/31/24	4, 750, 000. 000	4, 615, 292. 940	
US T N/B 2. 25 03/31/26	1, 300, 000. 000	1, 233, 781. 240	
US T N/B 2. 25 04/30/24	3, 300, 000. 000	3, 202, 546. 870	
US T N/B 2. 25 05/15/41	3, 420, 000. 000	2, 664, 660. 900	
US T N/B 2. 25 08/15/27	4, 240, 000. 000	3, 968, 209. 330	
US T N/B 2. 25 08/15/46	2, 070, 000. 000	1, 531, 314. 820	
US T N/B 2. 25 08/15/49	3, 040, 000. 000	2, 238, 912. 460	
US T N/B 2. 25 10/31/24	2, 350, 000. 000	2, 264, 628. 890	
US T N/B 2. 25 11/15/24	3, 080, 000. 000	2, 968, 590. 600	
US T N/B 2. 25 11/15/25	2, 920, 000. 000	2, 782, 212. 500	
US T N/B 2. 25 11/15/27	3, 270, 000. 000	3, 052, 085. 130	
US T N/B 2. 25 12/31/23	280, 000. 000	273, 426. 560	
US T N/B 2. 25 12/31/24	3, 000, 000. 000	2, 886, 796. 860	
US T N/B 2. 375 02/15/42	3, 610, 000. 000	2, 855, 002. 320	
US T N/B 2. 375 03/31/29	3, 000, 000. 000	2, 775, 820. 290	
US T N/B 2. 375 04/30/26	1, 260, 000. 000	1, 199, 559. 370	
US T N/B 2. 375 05/15/27	4, 430, 000. 000	4, 177, 697. 620	
US T N/B 2. 375 05/15/29	3, 470, 000. 000	3, 208, 258. 960	
US T N/B 2. 375 05/15/51	4, 760, 000. 000	3, 575, 950. 000	
US T N/B 2. 375 08/15/24	4, 610, 000. 000	4, 462, 515. 990	
US T N/B 2. 375 11/15/49	3, 790, 000. 000	2, 869, 444. 510	
US T N/B 2. 5 01/31/24	2, 550, 000. 000	2, 493, 023. 430	
US T N/B 2. 5 01/31/25	500, 000. 000	483, 046. 870	
US T N/B 2. 5 02/15/45	2, 310, 000. 000	1, 814, 071. 870	
US T N/B 2. 5 02/15/46	1, 770, 000. 000	1, 381, 567. 950	
US T N/B 2. 5 02/28/26	2, 280, 000. 000	2, 181, 675. 000	
US T N/B 2. 5 03/31/27	2, 650, 000. 000	2, 513, 669. 900	
US T N/B 2. 5 04/30/24	4, 010, 000. 000	3, 903, 014. 440	
US T N/B 2. 5 05/15/24	5, 100, 000. 000	4, 962, 539. 020	
US T N/B 2. 5 05/15/46	2, 230, 000. 000	1, 740, 619. 540	
US T N/B 2. 5 05/31/24	4, 180, 000. 000	4, 065, 703. 120	
US T N/B 2. 625 01/31/26	2, 460, 000. 000	2, 367, 365. 620	
US T N/B 2. 625 02/15/29	4, 330, 000. 000	4, 069, 354. 240	
US T N/B 2. 625 03/31/25	1, 790, 000. 000	1, 732, 524. 200	
US T N/B 2. 625 04/15/25	3, 000, 000. 000	2, 900, 625. 000	
US T N/B 2. 625 05/31/27	3, 410, 000. 000	3, 250, 023. 010	
US T N/B 2. 625 07/31/29	2, 570, 000. 000	2, 409, 174. 200	
US T N/B 2. 625 12/31/23	3, 530, 000. 000	3, 460, 227. 320	
US T N/B 2. 625 12/31/25	1, 000, 000. 000	963, 164. 060	
US T N/B 2. 75 02/15/24	2, 090, 000. 000	2, 047, 383. 580	

US T N/B 2.75 02/15/28	3,370,000.000	3,211,899.580	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,902,578.100	
US T N/B 2.75 04/30/27	3,000,000.000	2,874,375.000	
US T N/B 2.75 05/15/25	4,000,000.000	3,876,875.000	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,118,500.000	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,007,500.000	
US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,655,411.700	
US T N/B 2.75 08/15/32	4,840,000.000	4,504,225.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,540,000.000	1,288,185.920	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,817,624.200	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,769,667.180	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,297,558.120	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,833,398.420	
US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,944,375.000	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,000,000.000	2,856,796.860	
US T N/B 2.875 05/15/28	5,360,000.000	5,135,131.200	
US T N/B 2.875 05/15/32	6,650,000.000	6,264,507.800	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,943,995.300	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,300,000.000	2,772,515.620	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,779,591.370	
US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,525,475.760	
US T N/B 2.875 06/15/25	7,120,000.000	6,919,193.710	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,138,812.500	
US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,326,857.810	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,483,688.650	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	902,475.000	
US T N/B 2.875 11/30/25	1,360,000.000	1,318,084.360	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,673,962.490	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,265,957.010	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,310,000.000	2,846,082.810	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	942,637.500	
US T N/B 3.0 05/15/45	400,000.000	342,625.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,382,315.620	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,117,624.980	
US T N/B 3.0 07/31/24	3,820,000.000	3,735,989.830	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,810,000.000	2,406,062.500	
US T N/B 3.0 08/15/52	3,530,000.000	3,041,867.180	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,703,242.180	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,270,000.000	1,235,521.470	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,340,381.240	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	736,710.930	
US T N/B 3.125 02/15/42	860,000.000	768,289.050	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,740,000.000	1,540,035.920	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,475,586.700	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,959,457.810	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,834,954.680	
US T N/B 3.125 08/31/27	1,730,000.000	1,683,506.250	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	3,004,308.570	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,241,414.030	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	913,378.120	

US T N/B 3. 25 05/15/42	3,760,000.000	3,415,137.490	
US T N/B 3. 25 06/30/27	3,500,000.000	3,421,660.130	
US T N/B 3. 25 06/30/29	3,000,000.000	2,918,554.680	
US T N/B 3. 375 05/15/44	1,430,000.000	1,308,338.260	
US T N/B 3. 375 08/15/42	1,500,000.000	1,386,796.870	
US T N/B 3. 375 11/15/48	3,200,000.000	2,938,749.960	
US T N/B 3. 5 02/15/39	500,000.000	485,781.250	
US T N/B 3. 5 09/15/25	3,000,000.000	2,959,687.500	
US T N/B 3. 625 02/15/44	1,630,000.000	1,553,211.710	
US T N/B 3. 625 08/15/43	1,470,000.000	1,402,471.870	
US T N/B 3. 75 08/15/41	820,000.000	806,034.360	
US T N/B 3. 75 11/15/43	1,960,000.000	1,904,875.000	
US T N/B 3. 875 08/15/40	1,290,000.000	1,301,690.620	
US T N/B 3. 875 09/30/29	3,250,000.000	3,284,150.380	
US T N/B 3. 875 11/30/27	7,000,000.000	7,048,671.840	
US T N/B 3. 875 11/30/29	2,300,000.000	2,324,437.500	
US T N/B 4. 0 10/31/29	2,000,000.000	2,036,562.500	
US T N/B 4. 0 11/15/42	1,200,000.000	1,214,625.000	
US T N/B 4. 0 11/15/52	2,460,000.000	2,572,429.670	
US T N/B 4. 0 12/15/25	1,000,000.000	1,000,625.000	
US T N/B 4. 125 09/30/27	2,000,000.000	2,030,390.620	
US T N/B 4. 125 10/31/27	3,940,000.000	4,003,717.200	
US T N/B 4. 125 11/15/32	2,500,000.000	2,604,882.800	
US T N/B 4. 25 05/15/39	950,000.000	1,011,007.800	
US T N/B 4. 25 09/30/24	2,200,000.000	2,195,316.390	
US T N/B 4. 25 10/15/25	2,800,000.000	2,816,625.000	
US T N/B 4. 25 11/15/40	600,000.000	634,031.250	
US T N/B 4. 375 02/15/38	600,000.000	647,625.000	
US T N/B 4. 375 05/15/40	910,000.000	978,463.270	
US T N/B 4. 375 05/15/41	230,000.000	246,692.960	
US T N/B 4. 375 10/31/24	2,070,000.000	2,070,929.880	
US T N/B 4. 375 11/15/39	1,000,000.000	1,078,203.120	
US T N/B 4. 5 02/15/36	400,000.000	438,750.000	
US T N/B 4. 5 05/15/38	600,000.000	656,531.240	
US T N/B 4. 5 08/15/39	980,000.000	1,073,482.790	
US T N/B 4. 5 11/15/25	3,570,000.000	3,617,135.130	
US T N/B 4. 5 11/30/24	2,200,000.000	2,207,476.560	
US T N/B 4. 625 02/15/40	890,000.000	988,247.630	
US T N/B 4. 75 02/15/41	830,000.000	933,425.770	
US T N/B 5. 0 05/15/37	555,000.000	638,163.270	
US T N/B 5. 25 11/15/28	850,000.000	915,941.400	
US T N/B 5. 375 02/15/31	860,000.000	962,326.540	
US T N/B 6. 0 02/15/26	400,000.000	423,531.240	
US T N/B 6. 125 11/15/27	200,000.000	220,593.750	
US T N/B 6. 25 05/15/30	759,000.000	881,685.230	
アメリカ・ドル 小計	771,170,000.000 (102,102,908,000)	693,375,911.420 (91,802,970,670)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0. 125 01/30/26	950,000.000	862,056.310
	UK TREASURY 0. 125	1,800,000.000	1,737,566.100

01/31/24			
UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,040,000.000	879,999.320	
UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,400,000.000	2,241,646.080	
UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,770,000.000	1,341,660.000	
UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,390,000.000	1,239,796.600	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	961,360.000	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	680,000.000	568,208.000	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,670,000.000	605,074.400	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	993,591.000	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,350,000.000	925,704.720	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	450,000.000	202,815.000	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,670,000.000	886,436.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	700,000.000	528,645.600	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	2,710,000.000	2,289,950.000	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,370,000.000	1,897,327.200	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	950,000.000	921,405.000	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	760,000.000	507,604.000	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	329,625.600	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,600,000.000	1,453,974.400	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,330,000.000	725,284.100	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,600,000.000	1,029,055.030	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,100,000.000	1,029,268.460	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	615,914.000	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	350,000.000	202,035.540	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,130,000.000	1,024,774.400	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	517,147.140	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	464,708.700	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	406,836.100	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	693,740.900	
UK TREASURY 1.75	1,390,000.000	1,059,597.000	

	09/07/37			
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,190,000.000	1,148,338.100	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	938,262.500	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	810,000.000	800,339.940	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,270,000.000	1,134,592.600	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,450,000.000	1,343,280.860	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	893,451.000	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	400,000.000	391,520.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	940,948.500	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	944,667.000	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	200,000.000	203,716.360	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,800,000.000	1,881,027.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,440,000.000	1,520,553.600	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,260,000.000	1,306,431.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	910,000.000	942,306.070	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,107,824.500	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	1,120,284.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	1,063,426.050	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,300,354.800	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	966,744.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,265,000.000	1,354,498.750	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,095,000.000	1,189,345.200	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	980,000.000	1,076,726.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,095,000.000	1,129,980.420	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	767,958.000	
	イギリス・ポンド 小計	63,814,000.000 (10,273,415,860)	54,609,382.950 (8,791,564,561)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	320,000.000	301,523.200	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	310,000.000	282,002.040	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,758,599.640	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,435,967.820	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5	1,450,000.000	1,129,741.400	

	05/31/37			
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,300,000.000	2,193,429.500	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,230,000.000	2,103,902.420	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,460,000.000	1,372,880.340	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	1,320,000.000	1,317,378.480	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,570,000.000	1,616,541.080	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,090,000.000	1,391,093.970	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	220,000.000	241,095.800	
イスラエル・シュケル 小計		17,020,000.000 (650,458,446)	16,144,155.690 (616,986,041)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,990,000.000	1,882,782.510	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,160,000.000	1,064,060.800	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,815,000.000	1,635,228.960	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,170,000.000	1,731,295.310	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,366,014.410	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,890,000.000	1,525,681.610	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,610,000.000	1,357,446.250	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,200,000.000	727,080.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,551,784.480	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	880,000.000	825,308.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,680,717.350	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	970,000.000	963,513.750	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	900,000.000	745,040.400	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	578,799.270	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,230,000.000	1,188,918.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	960,000.000	921,925.950	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,325,100.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	880,000.000	732,084.420	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,620,000.000	1,512,087.710	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,380,000.000	1,379,048.480	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,500,000.000	1,475,911.270	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,020,000.000	924,260.110	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	811,715.630	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	600,000.000	598,565.020	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,200,000.000	1,234,045.060		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,230,000.000	1,311,751.210		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,440,000.000	1,516,474.800		
オーストラリア・ドル 小計		35,855,000.000 (3,274,637,150)	32,566,640.760 (2,974,311,301)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	10,000,000.000	9,946,326.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,200,000.000	4,190,997.130	

2.18 06/25/24			
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.18 08/25/25	30,000,000.000	29,774,456.090	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,449,353.950	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.26 02/24/25	34,500,000.000	34,392,099.870	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.28 03/17/24	12,000,000.000	12,005,448.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.44 10/15/27	4,000,000.000	3,964,147.880	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,325,162.380	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.48 04/15/27	30,100,000.000	29,876,294.680	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,264,189.530	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.6 09/01/32	7,300,000.000	7,117,994.940	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.62 09/25/29	17,500,000.000	17,290,826.170	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,528,520.150	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,687,604.440	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.69 08/15/32	13,000,000.000	12,758,460.390	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.75 02/17/32	20,000,000.000	19,778,004.400	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.75 06/15/29	20,000,000.000	19,931,400.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.76 05/15/32	3,000,000.000	2,964,132.540	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 03/24/29	11,000,000.000	10,985,480.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 11/15/32	6,300,000.000	6,266,421.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.85 06/04/27	7,500,000.000	7,557,101.250	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,105,016.760	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.91 10/14/28	15,600,000.000	15,752,282.520	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.02 05/27/31	1,000,000.000	1,012,290.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.25 06/06/26	450,000.000	461,274.030	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,607,430.400	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.32 04/15/52	13,320,000.000	13,507,417.720	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	5,100,000.000	5,180,666.190	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	18,950,000.000	19,791,095.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,243,357.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,260,347.180	
オフショア・人民元 小計		376,920,000.000 (7,354,010,736)	376,975,599.140 (7,355,095,520)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,272,305.040	
	CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,430,659.500	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,910,000.000	1,757,582.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,473,444.000	
	CANADA 0.75 02/01/24	200,000.000	192,705.400	
	CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	767,327.580	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	501,641.250	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,165,545.040	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	663,709.200	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,210,000.000	1,114,142.590	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,625,254.600	
	CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,046,313.400	
	CANADA 1.5 05/01/24	940,000.000	908,324.820	
	CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	657,559.000	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,175,783.480	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	423,045.920	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,020,000.000	1,767,124.280	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,070,000.000	1,504,126.170	
	CANADA 2.0 06/01/28	850,000.000	804,214.750	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,940,000.000	1,764,237.940	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,940,000.000	2,301,429.060	
	CANADA 2.25 03/01/24	420,000.000	410,813.340	
	CANADA 2.25 06/01/25	800,000.000	774,584.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	430,000.000	409,765.920	
	CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	475,236.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	970,000.000	949,367.130	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,300,000.000	1,231,859.200	
	CANADA 2.75 08/01/24	590,000.000	578,428.330	
	CANADA 2.75 09/01/27	850,000.000	832,223.950	
	CANADA 2.75 12/01/48	630,000.000	584,256.960	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	355,165.590	
	CANADA 3.0 10/01/25	500,000.000	491,308.500	
	CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	846,008.660	
	CANADA 3.5 03/01/28	480,000.000	486,572.160	
CANADA 3.5 12/01/45	700,000.000	734,839.000		
CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,157,166.120		
CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	631,142.760		
CANADA 5.0 06/01/37	340,000.000	409,633.360		
CANADA 5.75 06/01/29	1,090,000.000	1,256,466.980		
CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	748,542.590		

カナダ・ドル 小計		41,870,000.000 (4,127,963,300)	38,679,855.570 (3,813,446,961)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	380,000.000	355,566.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	410,000.000	387,450.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	350,000.000	316,841.990	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	429,730.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	410,000.000	362,173.500	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	276,358.370	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	370,000.000	361,268.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	547,579.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	769,470.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	140,000.000	130,620.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	420,000.000	416,304.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	500,000.000	522,500.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	340,000.000	349,936.500	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	480,000.000	480,864.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	619,690.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	138,679.430	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	808,894.350	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	330,000.000	344,355.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	821,360.000		
シンガポール・ドル 小計		8,625,000.000 (857,670,000)	8,439,640.140 (839,237,816)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,540,000.000	3,870,759.950	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	2,890,000.000	2,684,344.990	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,010,000.000	2,755,622.190	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	6,210,000.000	5,909,426.730	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,800,000.000	2,851,352.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,120,000.000	6,111,992.880	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,420,000.000	4,145,467.500	
スウェーデン・クローナ 小計		28,990,000.000 (368,752,800)	28,328,966.240 (360,344,451)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	980,000.000	933,254.000	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,180,000.000	3,351,114.360	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,970,000.000	1,685,678.500	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	5,783,632.060	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,750,000.000	5,042,492.390	
	DENMARK 1.75 11/15/25	4,040,000.000	3,947,078.780	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,960,000.000	10,116,211.940	
デンマーク・クローネ 小計		32,230,000.000 (616,559,900)	30,859,462.030 (590,341,509)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	350,000.000	283,986.930	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	650,000.000	612,594.390	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	360,000.000	316,279.720	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	350,000.000	283,535.000	
	NEW ZEALAND 1.75	400,000.000	266,327.030	

	05/15/41			
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	350,000.000	290,898.720	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	450,000.000	431,737.390	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	330,000.000	273,319.060	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	440,000.000	330,152.570	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	350,000.000	326,337.870	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	350,000.000	329,057.930	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	129,597.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	700,000.000	704,547.480	
ニュージーランド・ドル 小計		5,210,000.000 (439,567,700)	4,578,371.090 (386,277,169)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,281,716.250	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,819,336.670	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,480,000.000	4,278,776.320	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,286,636.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,540,000.000	5,381,556.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,300,000.000	3,047,863.500	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,971,054.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,170,000.000	1,077,892.920	
	NORWAY 3.0 03/14/24	2,370,000.000	2,362,688.920	
ノルウェー・クローネ 小計		28,290,000.000 (375,691,200)	26,507,520.580 (352,019,873)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,524,962.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	3,370,000.000	3,005,871.500	
	POLAND 07/25/24	1,710,000.000	1,563,395.600	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,930,000.000	2,805,116.100	
	POLAND 1.75 04/25/32	2,160,000.000	1,518,264.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	2,017,501.950	
	POLAND 2.5 04/25/24	780,000.000	746,809.440	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,481,381.360	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,048,008.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,480,000.000	2,994,505.200	
	POLAND 2.75 10/25/29	630,000.000	521,498.250	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,730,000.000	3,499,045.860	
	POLAND 3.75 05/25/27	1,450,000.000	1,344,295.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,433,160.000	
ポーランド・ズロチ 小計		31,860,000.000 (965,759,436)	27,503,814.260 (833,712,120)	
マレーシア・リ ンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	903,271.890	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	1,000,915.400	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	642,282.290	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,359,473.580	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,985,699.100	

	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,392,334.420	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,779,100.670	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,625,992.070	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	300,000.000	302,240.400	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	696,959.830	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	600,000.000	603,156.600	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,430,000.000	1,437,407.400	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,672,447.330	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	320,000.000	322,699.230	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,400,000.000	2,423,353.680	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	908,860.050	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	400,000.000	370,062.020	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,030,000.000	1,040,828.180	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	480,000.000	487,580.300	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	600,000.000	608,259.300	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,074,526.110	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,237,822.200	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	300,000.000	309,006.660	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	525,177.450	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	680,000.000	717,427.600	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	310,731.390	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,797,747.790	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	620,000.000	665,924.140	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,097,979.780	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,716,799.040	
	マレーシア・リンギット 小計	31,790,000.000 (962,095,739)	32,016,065.900 (968,937,420)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	11,580,000.000	10,304,694.600	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	9,180,000.000	8,377,530.300	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	2,800,000.000	2,574,460.000	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	6,290,000.000	5,814,923.210	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	6,109,467.250	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	15,502,000.000	15,595,066.410	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	28,522,000.000	26,027,637.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	24,746,000.000	23,773,234.740	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,648,000.000	29,192,986.200	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	17,277,000.000	15,606,659.640	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	4,835,000.000	4,526,817.100	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,354,619.250	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	16,161,000.000	14,925,168.330	
	MEXICAN BONDS 8.5	20,159,000.000	20,138,034.640	

	05/31/29			
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	15,302,255.760	
メキシコ・ペソ	小計	230,897,000.000 (1,604,433,984)	219,623,554.430 (1,526,098,193)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	930,000.000	763,367.250	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	710,000.000	565,198.340	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	580,000.000	546,089.140	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	570,000.000	487,961.040	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	264,330.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	380,000.000	261,440.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	920,000.000	804,567.600	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	978,110.120	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	210,000.000	101,932.320	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	760,534.700	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	355,547.570	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,070,000.000	1,001,092.000	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	145,137.970	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	900,000.000	758,057.080	
	AUSTRIA 07/15/24	520,000.000	499,842.200	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,010,000.000	974,055.110	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	640,000.000	485,880.320	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	121,752.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	930,000.000	912,997.330	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	290,000.000	236,445.170	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	160,000.000	156,816.640	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	313,855.670	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	620,000.000	585,487.700	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	540,000.000	553,671.180	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	240,000.000	288,697.920	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	940,000.000	1,058,628.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	710,000.000	759,849.450	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	415,000.000	479,449.500	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	512,547.160	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	737,607.950	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	1,300,000.000	1,075,880.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	600,000.000	475,980.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	450,000.000	283,142.250	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	750,000.000	722,044.500	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	520,000.000	239,330.520	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,980,000.000	1,895,582.700	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	960,000.000	886,665.600	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	1,010,000.000	917,585.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,430,000.000	1,285,799.730	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,030,000.000	977,242.700	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,070,000.000	928,968.650	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	694,710.590	
	BELGIUM 1.4 06/22/53	710,000.000	472,307.620	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	380,000.000	306,178.540	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	780,000.000	576,223.240	

BELGIUM 1. 7 06/22/50	980,000.000	722,196.300	
BELGIUM 1. 9 06/22/38	610,000.000	517,123.230	
BELGIUM 2. 15 06/22/66	450,000.000	368,280.000	
BELGIUM 2. 25 06/22/57	390,000.000	326,241.240	
BELGIUM 2. 6 06/22/24	840,000.000	838,230.960	
BELGIUM 2. 75 04/22/39	220,000.000	207,553.720	
BELGIUM 3. 0 06/22/34	980,000.000	977,307.940	
BELGIUM 3. 75 06/22/45	740,000.000	809,201.100	
BELGIUM 4. 0 03/28/32	630,000.000	686,705.040	
BELGIUM 4. 25 03/28/41	1,280,000.000	1,461,234.790	
BELGIUM 4. 5 03/28/26	880,000.000	930,774.240	
BELGIUM 5. 0 03/28/35	1,320,000.000	1,575,732.030	
BELGIUM 5. 5 03/28/28	1,570,000.000	1,788,495.330	
BUNDESOBL 0. 0 04/10/26	2,110,000.000	1,953,986.600	
BUNDESOBL 0. 0 04/11/25	1,590,000.000	1,503,216.210	
BUNDESOBL 0. 0 04/16/27	1,360,000.000	1,231,545.280	
BUNDESOBL 0. 0 10/09/26	1,360,000.000	1,244,182.400	
BUNDESOBL 0. 0 10/10/25	1,750,000.000	1,637,422.500	
BUNDESOBL 0. 0 10/10/25	950,000.000	892,021.500	
BUNDESOBL 04/05/24	1,260,000.000	1,220,058.000	
BUNDESOBL 1. 3 10/15/27	1,210,000.000	1,153,964.900	
BUNDESOBL 1. 3 10/15/27	1,790,000.000	1,709,056.200	
BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,519,934.260	
BUNDESSCHAT 0. 0 03/15/24	1,500,000.000	1,454,895.000	
BUNDESSCHAT 0. 2 06/14/24	1,250,000.000	1,207,812.500	
BUNDESSCHAT 0. 4 09/13/24	900,000.000	867,546.000	
BUNDESSCHAT 2. 2 12/12/24	700,000.000	694,379.000	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/30	2,120,000.000	1,809,314.000	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/31	1,540,000.000	1,285,776.800	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/32	2,900,000.000	2,363,531.900	
DEUTSCHLAND 0. 0 05/15/35	1,660,000.000	1,236,799.600	
DEUTSCHLAND 0. 0 05/15/36	1,580,000.000	1,149,102.400	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/30	2,630,000.000	2,221,508.400	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/30	590,000.000	498,319.900	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/31	1,890,000.000	1,560,100.500	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/31	800,000.000	661,000.000	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/50	2,230,000.000	1,234,095.380	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/50	710,000.000	392,637.100	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/52	1,040,000.000	552,385.600	
DEUTSCHLAND 0. 0 11/15/27	1,620,000.000	1,450,499.400	
DEUTSCHLAND 0. 0 11/15/28	2,060,000.000	1,807,347.180	
DEUTSCHLAND 0. 25 02/15/27	2,120,000.000	1,949,679.200	
DEUTSCHLAND 0. 25 02/15/29	2,080,000.000	1,844,485.760	
DEUTSCHLAND 0. 25 08/15/28	1,770,000.000	1,582,716.300	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/25	1,900,000.000	1,821,796.000	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/26	2,860,000.000	2,698,410.000	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/28	1,940,000.000	1,774,304.600	

DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,910,000.000	1,762,244.310	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,980,000.000	1,820,883.240	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,990,000.000	1,717,338.160	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	350,000.000	286,762.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,820,000.000	1,775,772.180	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,330,193.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,430,000.000	1,976,566.860	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,520,000.000	1,498,213.650	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,430,000.000	1,356,769.700	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,430,000.000	1,417,510.380	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	600,000.000	541,542.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	800,000.000	789,696.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,810,000.000	1,867,938.100	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,170,000.000	2,264,570.770	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,511,983.900	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,830,000.000	2,179,041.390	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	2,127,431.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	560,000.000	628,801.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,820,000.000	2,257,400.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	1,875,624.300	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,520,000.000	1,867,365.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,510,141.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	976,965.600	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	1,001,376.500	
FINLAND 0.0 09/15/24	410,000.000	392,576.290	
FINLAND 0.0 09/15/26	460,000.000	417,128.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	169,265.590	
FINLAND 0.125 04/15/36	290,000.000	200,831.960	
FINLAND 0.125 04/15/52	310,000.000	152,991.200	
FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	238,203.600	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	182,483.950	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	431,033.800	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	241,216.400	
FINLAND 0.5 09/15/27	420,000.000	379,257.900	
FINLAND 0.5 09/15/28	460,000.000	406,899.440	
FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	259,283.290	
FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	169,723.400	
FINLAND 0.875 09/15/25	350,000.000	334,354.510	
FINLAND 1.125 04/15/34	580,000.000	480,599.020	
FINLAND 1.375 04/15/27	110,000.000	104,144.590	
FINLAND 1.375 04/15/47	390,000.000	296,565.750	

FINLAND 1.5 09/15/32	50,000.000	44,274.850	
FINLAND 2.0 04/15/24	370,000.000	366,602.290	
FINLAND 2.625 07/04/42	440,000.000	420,835.800	
FINLAND 2.75 07/04/28	540,000.000	541,971.540	
FINLAND 4.0 07/04/25	410,000.000	424,226.410	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,220,000.000	1,183,711.100	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,990,000.000	1,878,098.320	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,910,000.000	2,681,905.470	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,450,000.000	2,203,863.200	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,290,000.000	1,775,666.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,890,000.000	2,421,626.370	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,480,000.000	2,831,867.400	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,581,579.980	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,620,000.000	2,395,142.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	4,430,000.000	4,210,191.720	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,460,000.000	3,225,031.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,152,912.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,650,000.000	1,079,741.850	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	331,539.300	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,150,000.000	697,424.400	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	1,980,000.000	1,803,780.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,110,000.000	4,636,170.140	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,040,000.000	1,155,176.520	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,050,000.000	1,132,793.100	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,400,000.000	3,059,320.000	
FRANCE OAT 03/25/24	3,020,000.000	2,923,797.900	
FRANCE OAT 03/25/25	3,320,000.000	3,128,784.600	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,360,000.000	2,205,202.880	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,617,960.900	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,860,000.000	2,397,932.680	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,190,000.000	2,569,226.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	500,000.000	387,850.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,280,000.000	3,923,390.400	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,470,000.000	1,770,826.980	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	722,287.560	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,070,000.000	1,731,141.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,380,000.000	2,337,252.820	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,587,150.000	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,600,000.000	1,491,830.400	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,484,035.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,450,000.000	4,419,659.900	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	250,000.000	226,564.500	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	5,190,000.000	5,228,198.400	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,030,000.000	2,086,827.820	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,000,000.000	3,081,450.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,813,050.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	1,425,358.350	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,155,636.820	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,142,199.280	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,930,000.000	2,271,320.500	

FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,360,000.000	2,753,709.360	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,142,926.620	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,362,191.680	
IRISH 0.0 10/18/31	770,000.000	608,725.530	
IRISH 0.2 05/15/27	520,000.000	470,009.950	
IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	455,788.740	
IRISH 0.35 10/18/32	400,000.000	318,302.000	
IRISH 0.4 05/15/35	330,000.000	243,212.640	
IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	162,336.000	
IRISH 0.9 05/15/28	610,000.000	559,146.740	
IRISH 1.0 05/15/26	950,000.000	905,243.600	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	665,806.720	
IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	336,690.900	
IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	327,139.200	
IRISH 1.5 05/15/50	580,000.000	422,212.740	
IRISH 1.7 05/15/37	400,000.000	339,458.050	
IRISH 2.0 02/18/45	740,000.000	613,013.780	
IRISH 2.4 05/15/30	590,000.000	580,403.060	
IRISH 3.4 03/18/24	390,000.000	393,483.090	
IRISH 5.4 03/13/25	850,000.000	899,139.350	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	969,800.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,520,000.000	1,365,720.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,400,000.000	1,348,508.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,250,000.000	1,110,500.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,460,000.000	1,391,453.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,283,445.600	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,229,028.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,702,636.200	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,200,000.000	983,640.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,478,942.780	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	928,070.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,720,000.000	1,301,787.160	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,310,000.000	1,187,056.500	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,610,000.000	1,267,253.540	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,080,000.000	706,104.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,380,000.000	1,049,076.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,088,370.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,180,000.000	1,051,380.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,002,762.800	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	999,405.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,291,184.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,530,000.000	1,413,198.270	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,750,000.000	1,474,726.830	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	804,272.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,280,000.000	1,233,863.680	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,010,873.760	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	482,679.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,460,000.000	1,406,096.800	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,350,000.000	1,276,290.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,790,000.000	1,467,062.520	

ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,470,587.100	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,020,000.000	601,039.080	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,176,958.800	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	786,485.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	974,150.100	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,740,000.000	1,685,190.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,350,000.000	1,253,272.500	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,603,662.920	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,300,000.000	2,164,842.800	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,290,000.000	1,236,666.240	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	215,172.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	327,879.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,290,000.000	1,228,080.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	860,000.000	681,550.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,125,047.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	812,590.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,350,000.000	1,326,461.400	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,621,325.720	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,159,341.200	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,220,000.000	1,169,492.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,090,000.000	833,850.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	499,800.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,129,200.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,740,000.000	1,662,021.900	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,810,000.000	1,510,264.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,538,752.670	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,580,000.000	1,333,388.860	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	522,960.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	995,738.280	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,120,000.000	1,011,850.560	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	750,000.000	738,450.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,033,568.550	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	300,000.000	301,290.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,836,605.540	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,636,765.380	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	783,071.850	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	800,000.000	796,240.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,170,000.000	2,102,079.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	660,000.000	637,626.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	200,000.000	201,560.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,710,000.000	1,737,243.720	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,910,000.000	1,978,760.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,773,102.240	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,161,905.820	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	581,907.200	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,756,778.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,170,000.000	1,251,783.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,250,000.000	1,337,750.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,140,000.000	2,339,662.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,638,704.000	

ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,848,280.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,510,000.000	1,711,585.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	399,035.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	640,000.000	592,367.550	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,067,377.260	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,110,000.000	955,089.510	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	370,607.600	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,000,000.000	512,631.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	580,693.400	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	900,000.000	726,681.600	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,430,000.000	1,350,258.920	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,010,000.000	875,887.150	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,210,000.000	858,361.900	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,420,000.000	1,323,440.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	200,000.000	165,064.800	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,073,951.200	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,240,000.000	1,131,362.360	
NETHERLANDS 01/15/24	830,000.000	808,512.960	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	360,000.000	325,716.120	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,440,000.000	1,426,528.800	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,097,267.300	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,430,000.000	1,493,534.900	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,420,000.000	1,650,143.660	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,280,000.000	1,468,800.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	780,000.000	891,462.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,322,510.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,470,000.000	1,348,720.590	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,610,000.000	1,433,141.500	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	1,004,038.000	
SPAIN 0.0 05/31/24	1,260,000.000	1,212,063.300	
SPAIN 0.0 05/31/25	670,000.000	626,596.670	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,380,000.000	1,075,710.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,038,717.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,500,000.000	1,253,314.500	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,305,246.480	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,630,000.000	1,392,434.020	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,550,000.000	1,235,195.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,750,000.000	1,594,687.500	
SPAIN 0.8 07/30/29	700,000.000	608,825.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	700,000.000	481,957.000	
SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	342,576.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,240,000.000	676,916.000	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	855,678.600	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,535,100.000	

	SPAIN 1.3 10/31/26	1,730,000.000	1,637,635.300	
	SPAIN 1.4 04/30/28	1,170,000.000	1,081,909.530	
	SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,395,164.500	
	SPAIN 1.45 04/30/29	1,400,000.000	1,278,925.200	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,560,000.000	1,459,476.720	
	SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	202,020.940	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,210,000.000	2,089,776.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,588,557.250	
	SPAIN 1.85 07/30/35	1,840,000.000	1,540,650.600	
	SPAIN 1.9 10/31/52	670,000.000	450,363.280	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,330,000.000	1,294,248.270	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,637,542.050	
	SPAIN 2.15 10/31/25	2,410,000.000	2,373,389.690	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,339,905.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,609,871.840	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,190,000.000	1,004,761.030	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,190,000.000	2,189,036.400	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,047,568.600	
	SPAIN 3.45 07/30/43	250,000.000	239,740.700	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,046,030.720	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,487,713.500	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,400,000.000	1,505,210.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,135,000.000	1,187,263.340	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,630,000.000	1,870,733.070	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,200,000.000	1,224,812.400	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,290,000.000	1,508,655.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,330,000.000	2,598,649.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,486,926.650	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,615,000.000	1,957,191.850	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,799,816.660	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,460,000.000	1,705,517.980	
	ユーロ 小計	471,767,000.000 (67,108,855,750)	436,198,301.780 (62,049,208,428)	
国債証券 合計		201,082,780,000.900 (201,082,780,001)	183,260,552,033 (183,260,552,033)	
合計			183,260,552,033 (183,260,552,033)	

(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 261銘柄	50.68	50.09
イギリス・ポンド	国債証券 55銘柄	4.85	4.80
イスラエル・シェケル	国債証券 12銘柄	0.34	0.34
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.64	1.62
オブショア・人民元	国債証券 31銘柄	4.06	4.01

カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	2.11	2.08
シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	0.46	0.46
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.20	0.20
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.33	0.32
ニュージーランド・ドル	国債証券	13銘柄	0.21	0.21
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.19	0.19
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	0.46	0.45
マレーシア・リングgit	国債証券	30銘柄	0.53	0.53
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.84	0.83
ユーロ	国債証券	358銘柄	34.25	33.86

(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)

2023年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,273,619,660
コール・ローン	4,554,635,942
株式	91,379,149,211
投資信託受益証券	565,157,044
投資証券	93,850,461
派生商品評価勘定	310,762,171
未収入金	128,634,877
未収配当金	102,800,396
差入委託証拠金	1,428,304,744
流動資産合計	102,836,914,506
資産合計	102,836,914,506
負債の部	
流動負債	
未払金	26,995
未払解約金	4,147,285,000
流動負債合計	4,147,311,995
負債合計	4,147,311,995
純資産の部	
元本等	
元本	70,027,488,260
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	28,662,114,251
元本等合計	98,689,602,511
純資産合計	98,689,602,511
負債純資産合計	102,836,914,506

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
	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。	
	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
	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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4. 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	2023年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,702,663,813円
同期中追加設定元本額	61,570,649,032円
同期中一部解約元本額	45,245,824,585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<DC年金>	8,939,235,619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)	221,373,908円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,360,482円

MITO ラップ型ファンド (中立型)	14,873,547円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	47,963,706円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,778,979円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	20,650,978円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	30,267,775円
たわらノーロード 新興国株式	10,823,532,925円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,807,493,692円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,448,525,572円
たわらノーロード バランス (堅実型)	31,496,219円
たわらノーロード バランス (標準型)	119,283,395円
たわらノーロード バランス (積極型)	200,926,526円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	93,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	104,324,038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)	261,874,040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)	186,387,988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)	318,174,216円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	704,729円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	8,890,183円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,353,416円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	7,068,234円
たわらノーロード 全世界株式	332,047,143円
One DC 新興国株式インデックスファンド	723,807,245円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	393,257,262円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	366,379,426円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	568,786,720円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	1,041,246,012円
投資のソムリエ	23,273,396,479円
クルーズコントロール	81,614,813円
投資のソムリエ<DC年金>	1,681,147,034円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	446,925,491円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,872,449,573円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	8,129,863,305円
ワールドアセットバランス (基本コース)	622,686,789円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	381,005,501円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	71,800,890円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	36,039,126円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	12,882,758円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	265,998,584円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	598,155,802円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	335,406,294円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	90,344,235円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	38,192,588円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	23,864,626円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,012,772円
エマージング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用)	11,093,992円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	631,642,248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)	12,405,252円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	21,852,530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)	228,075,182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)	102,475,330円
計	70,027,488,260円

2. 受益権の総数	70,027,488,260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 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	2023年1月11日現在 当期の

	損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	△1,983,383,286
投資信託受益証券	△29,037,184
投資証券	6,947,528
合計	△2,005,472,942

(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2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等 (円)	時価 (円)		評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	716,848,140	—	717,980,995	1,132,855
	716,848,140	—	717,980,995	1,132,855
合計	716,848,140	—	717,980,995	1,132,855

(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。

①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。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等 (円)	時価 (円)		評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	6,768,705,722	—	7,078,335,038	309,629,316
合計	6,768,705,722	—	7,078,335,038	309,629,316

(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)

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.4093円
(1万口当たり純資産額)	(14,093円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	55,584	37.650	2,092,737.600	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,959	8.140	146,186.260	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,612	148.000	1,126,576.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,272	71.820	594,095.040	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	306,034	1.248	381,930.430	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	131,500	1.380	181,470.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,488	0.833	72,044.500	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	57,440	3.100	178,064.000	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	50,259	1.150	57,797.850	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC	7,574	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	107,951	0.000	0.000	
	SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000	
	TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000	
	VTB BANK PJSC	304,000,000	0.000	0.000	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,473	15.150	658,615.950		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	46,195	9.500	438,852.500		
VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000		

	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	897,112	0.000	0.000	
	YANDEX NV	25,601	0.000	0.000	
	PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000	
	H WORLD GROUP LTD ADR	20,483	44.190	905,143.770	
	JOYY INC-ADR	4,368	36.890	161,135.520	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,996	44.530	267,001.880	
	ZAI LAB LTD ADR	8,902	42.260	376,198.520	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	360 DIGITECH INC ADR	12,687	22.980	291,547.260	
	NIO INC ADR	142,587	11.240	1,602,677.880	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	70,412	8.740	615,400.880	
	AUTOHOME INC ADR	7,801	35.730	278,729.730	
	WEIBO CORP ADR	8,996	20.800	187,116.800	
	KANZHUN LTD ADR	19,079	24.050	458,849.950	
	KE HOLDINGS INC ADR	69,275	18.170	1,258,726.750	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,058	49.810	251,938.980	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	2.470	149,281.860	
	PINDUODUO INC ADR	52,294	94.090	4,920,342.460	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	42,886	59.170	2,537,564.620	
	IQIYI INC ADR	40,457	6.030	243,955.710	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	42,575	28.200	1,200,615.000	
アメリカ・ドル	小計	307,779,792		21,634,597.700 (2,864,420,735)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	149,810	9.140	1,369,263.400	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	279,091	5.640	1,574,073.240	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	363,295	24.300	8,828,068.500	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	291,901	8.990	2,624,189.990	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	459,487	16.200	7,443,689.400	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	395,030	5.790	2,287,223.700	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	413,204	4.390	1,813,965.560	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	190,646	12.950	2,468,865.700	
	Q HOLDING PJSC	222,915	3.900	869,368.500	
	MULTIPLY GROUP	357,097	4.750	1,696,210.750	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	311,988	4.640	1,447,624.320	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	3,434,464		32,422,543.060 (1,170,778,030)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	316,568	2,558.400	809,907,571.200	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	88,686	347.350	30,805,082.100	

ASIAN PAINTS LTD	39,680	2,960.350	117,466,688.000
EICHER MOTORS LTD	13,332	3,167.550	42,229,776.600
GRASIM INDUSTRIES LTD	27,870	1,651.000	46,013,370.000
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	88,048	1,314.900	115,774,315.200
SHREE CEMENT LTD	1,110	23,559.500	26,151,045.000
ICICI BANK LTD	536,948	861.350	462,500,159.800
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	68,931	249.200	17,177,605.200
STATE BANK OF INDIA LTD	187,727	595.150	111,725,724.050
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	28,293	722.100	20,430,375.300
TATA STEEL LTD	758,027	118.850	90,091,508.950
TATA MOTORS LTD	170,813	412.900	70,528,687.700
JSW STEEL LTD	71,665	745.200	53,404,758.000
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	60,239	769.250	46,338,850.750
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,895	5,859.500	16,963,252.500
TATA POWER CO LTD	149,677	206.050	30,840,945.850
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,684	4,326.850	46,228,065.400
NESTLE INDIA LTD	3,501	20,023.950	70,103,848.950
GAIL INDIA LTD	257,886	98.100	25,298,616.600
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	57,534	1,795.550	103,305,173.700
VEDANTA LTD	74,877	316.050	23,664,875.850
AXIS BANK LTD	232,796	952.150	221,656,711.400
TITAN COMPANY LTD	37,021	2,468.200	91,375,232.200
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	263,145	149.350	39,300,705.750
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	14,144	1,499.850	21,213,878.400
BHARAT ELECTRONICS LTD	351,792	99.150	34,880,176.800
LUPIN LTD	17,511	758.850	13,288,222.350
MPHASIS LTD	8,886	1,988.750	17,672,032.500
ACC LTD	8,629	2,418.950	20,873,119.550
BAJAJ FINANCE LTD	28,559	5,904.150	168,616,619.850
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	179,804	2,575.350	463,058,231.400
INFOSYS LTD	350,646	1,469.750	515,361,958.500
WIPRO LTD	145,337	393.050	57,124,707.850
TATA ELXSI LTD	3,406	6,199.800	21,116,518.800
MRF LTD	215	94,163.950	20,245,249.250
INDIAN OIL CORP LTD	326,644	80.600	26,327,506.400
HINDUSTAN UNILEVER LTD	85,753	2,643.850	226,718,069.050
TRENT LTD	18,269	1,223.650	22,354,861.850
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	10,275	4,466.650	45,894,828.750
HCL TECHNOLOGIES LTD	112,189	1,063.850	119,352,267.650
DABUR INDIA LTD	63,591	554.600	35,267,568.600
HERO MOTOCORP LTD	10,549	2,712.050	28,609,415.450
SRF LTD	15,454	2,270.100	35,082,125.400

BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,829	2,189.550	19,331,536.950	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	12,180	4,288.700	52,236,366.000	
BHARTI AIRTEL LTD	227,302	792.850	180,216,390.700	
UNITED SPIRITS LTD	31,760	864.100	27,443,816.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	100,124	1,011.850	101,310,469.400	
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,384	3,501.850	50,370,610.400	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,201	8,293.150	101,184,723.150	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,102	450.000	9,495,900.000	
HAVELLS INDIA LTD	26,114	1,181.600	30,856,302.400	
TVS MOTOR COMPANY LTD	23,063	1,016.300	23,438,926.900	
INDRAPRASTHA GAS LTD	30,576	426.450	13,039,135.200	
JINDAL STEEL & POWER LTD	44,243	599.000	26,501,557.000	
BIOCON LTD	33,274	257.900	8,581,364.600	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	210,454	78.750	16,573,252.500	
SHRIRAM FINANCE LTD	26,086	1,333.900	34,796,115.400	
PETRONET LNG LTD	65,233	219.850	14,341,475.050	
CIPLA LTD/INDIA	51,586	1,078.700	55,645,818.200	
LARSEN & TOUBRO LTD	70,065	2,106.650	147,602,432.250	
ULTRATECH CEMENT LTD	10,332	6,920.300	71,500,539.600	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	95,636	3,286.400	314,298,150.400	
ADANI ENTERPRISES LTD	28,833	3,646.900	105,151,067.700	
NTPC LTD	385,873	167.950	64,807,370.350	
YES BANK LTD	1,230,792	20.650	25,415,854.800	
AMBUJA CEMENTS LTD	66,469	514.450	34,194,977.050	
BHARAT FORGE LTD	26,609	883.250	23,502,399.250	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	143,357	477.550	68,460,135.350	
ITC LTD	306,365	333.400	102,142,091.000	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	15,113	2,529.200	38,223,799.600	
UNITED PHOSPHORUS LTD	49,294	724.650	35,720,897.100	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	9,851	1,565.350	15,420,262.850	
SIEMENS INDIA LTD	7,173	2,870.150	20,587,585.950	
INFO EDGE INDIA LTD	7,579	3,687.150	27,944,909.850	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,211	911.650	37,570,008.150	
TECH MAHINDRA LTD	62,485	1,002.650	62,650,585.250	
INDIAN HOTELS CO LTD	92,561	310.350	28,726,306.350	
MARICO LTD	53,087	510.050	27,077,024.350	
PAGE INDUSTRIES LTD	589	41,038.400	24,171,617.600	
ABB LTD/INDIA	5,891	2,841.650	16,740,160.150	
DLF LTD	70,028	373.050	26,123,945.400	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	320,491	211.800	67,879,993.800	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	55,624	796.400	44,298,953.600	

BAJAJ FINSERV LTD	39,194	1,413.300	55,392,880.200	
BAJAJ AUTO LTD	6,864	3,574.200	24,533,308.800	
JUBILANT FOODWORKS LTD	40,548	492.100	19,953,670.800	
ADANI POWER LTD	77,437	279.200	21,620,410.400	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,565	1,074.350	12,424,857.750	
COAL INDIA LTD	156,007	216.750	33,814,517.250	
INDUS TOWERS LTD	64,346	183.200	11,788,187.200	
PI INDUSTRIES LTD	7,418	3,289.750	24,403,365.500	
VARUN BEVERAGES LTD	24,592	1,287.300	31,657,281.600	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	11,416	2,674.600	30,533,233.600	
LTIMINDTREE LTD	9,300	4,231.600	39,353,880.000	
ADANI GREEN ENERGY LTD	33,531	1,895.200	63,547,951.200	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	102,431	600.200	61,479,086.200	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	625.200	9,877,534.800	
BANDHAN BANK LTD	73,413	246.050	18,063,268.650	
ADANI TOTAL GAS LTD	27,988	3,656.400	102,335,323.200	
GODREJ PROPERTIES LTD	12,688	1,212.250	15,381,028.000	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	39,547	669.000	26,456,943.000	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	23,890	782.000	18,681,980.000	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	26,775	636.950	17,054,336.250	
ZOMATO LTD	332,258	54.700	18,174,512.600	
BERGER PAINTS INDIA LTD	28,692	566.850	16,264,060.200	
ADANI TRANSMISSIONS LTD	28,180	2,652.000	74,733,360.000	
AVENUE SUPERMARTS LTD	16,878	3,877.400	65,442,757.200	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	23,926	1,241.700	29,708,914.200	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	36,667	465.650	17,073,988.550	
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,662	2,044.150	19,750,577.300	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	45,847	1,302.600	59,720,302.200	
インド・ルピー 小計	10,720,284		7,757,136,648.700 (12,644,132,737)	
インドネシア・ルピア				
ANEKA TAMBANG TBK PT	902,200	2,040.000	1,840,488,000.000	
BARITO PACIFIC TBK PT	2,887,506	820.000	2,367,754,920.000	
UNITED TRACTORS TBK PT	169,701	24,950.000	4,234,039,950.000	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	509,800	6,675.000	3,402,915,000.000	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	822,500	4,690.000	3,857,525,000.000	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,066,300	5,325.000	11,003,047,500.000	
TELKOM INDONESIA PERSERO	5,035,700	3,830.000	19,286,731,000.000	

	TBK				
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	752,600	6,250.000	4,703,750,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	292,400	8,550.000	2,500,020,000.000	
	BANK MANDIRI	1,883,100	9,275.000	17,465,752,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	7,173,000	4,430.000	31,776,390,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	717,900	8,725.000	6,263,677,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,330,100	2,050.000	4,776,705,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	274,432	7,050.000	1,934,745,600.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,808,900	8,175.000	47,487,757,500.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	287,700	7,250.000	2,085,825,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,380,900	3,140.000	4,336,026,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	259,300	10,200.000	2,644,860,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,697,900	2,720.000	4,618,288,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	2,218,600	1,155.000	2,562,483,000.000	
	BANK JAGO TBK PT	428,300	2,970.000	1,272,051,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,232,482	4,400.000	5,422,920,800.000	
	インドネシア・ルピア 小計	39,131,321		185,843,753,270.000 (1,579,671,903)	
オフショア・人 民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	88.010	1,146,946.320	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	41.180	238,844.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	12.280	278,756.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	12.530	74,428.200	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	113.230	339,690.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	20,800	22.080	459,264.000	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	5,100	35.100	179,010.000	
	GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD	48,300	6.180	298,494.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	8.660	103,920.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,080	73.380	886,430.400	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	36,800	12.040	443,072.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	17.300	302,750.000	

UNISPLENDOUR CORP LTD	21,240	22.870	485,758.800	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	18.290	192,045.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.610	221,751.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	108.270	129,924.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	22.690	367,578.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	17.110	128,325.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	201.040	422,184.000	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	19.590	174,351.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	18,300	32.470	594,201.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	24.520	340,828.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	11.830	282,737.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	8.210	258,615.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	4.040	249,672.000	
GEM CO LTD	29,100	7.510	218,541.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	107.690	279,994.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	39.880	275,172.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	3.940	73,284.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	12.670	214,123.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	9,800	121.920	1,194,816.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	11,995	11.150	133,744.250	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	30.990	182,964.960	
ZHEJIANG NHU CO LTD	27,312	18.880	515,650.560	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	10.540	311,984.000	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	29.340	391,982.400	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	23.880	157,608.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	19,300	27.210	525,153.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	62.970	585,621.000	

GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	31.040	322,816.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	41,400	10.270	425,178.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	11,500	31.520	362,480.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	33,300	48.290	1,608,057.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	11,300	102.860	1,162,318.000	
WESTONE INFORMATION INDUSTRY INC	5,700	30.300	172,710.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	11.030	198,540.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	12.130	218,340.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	85.930	867,893.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	10.610	118,832.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	8.950	90,395.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	11.760	65,856.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	24.420	344,322.000	
DAAN GENE CO LTD	13,900	15.670	217,813.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	300	28.330	8,499.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	23.200	180,960.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	71,750	11.880	852,390.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	47.650	285,900.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	6,139	124.050	761,542.950	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	22.810	81,431.700	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.040	127,508.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	4.880	41,968.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	4.320	158,544.000	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	32,000	7.990	255,680.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	50,467	31.930	1,611,411.310	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	31.820	343,656.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	11,184	38.590	431,590.560	
SHENZHEN SALUBRIS	11,100	35.150	390,165.000	

PHARMACEUTICALS CO LTD				
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	23.340	161,046.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	28,700	5.510	158,137.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	40.830	200,067.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	8.420	128,826.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	49.400	370,500.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	28.330	141,650.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	99,100	3.190	316,129.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	6,600	20.460	135,036.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	25.580	250,684.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	10,000	239.000	2,390,000.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	17,800	67.900	1,208,620.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	9.110	136,194.500	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	22,300	40.840	910,732.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	31,240	14.770	461,414.800	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,448	15.360	114,401.280	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	108.000	226,800.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.020	219,609.600	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	9.160	130,988.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	45,054	29.650	1,335,851.100	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	23.090	690,391.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.400	148,500.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	7.030	501,239.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	12.690	252,531.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	11.620	221,942.000	
IFLYTEK CO LTD	11,800	34.120	402,616.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.260	211,084.000	
GOERTEK INC	25,100	18.280	458,828.000	

GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.530	139,089.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	45,200	32.510	1,469,452.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	39,600	10.640	421,344.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	135,200	3.870	523,224.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.420	153,386.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	5.370	201,912.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	68,188	13.360	910,991.680	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.170	140,059.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	27,400	25.630	702,262.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	55.020	578,810.400	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	84,349	21.000	1,771,329.000	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	10,300	176.800	1,821,040.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	22,900	195.240	4,470,996.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	76,600	6.460	494,836.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.670	800,427.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	13.880	637,092.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	18,700	34.120	638,044.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.030	381,969.000	
PING AN BANK CO LTD	128,100	14.440	1,849,764.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	29,180	19.180	559,672.400	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	146,300	4.020	588,126.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	18.800	1,035,880.000	
ZTE CORP	19,700	25.490	502,153.000	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	5.580	159,030.000	
WEICHAI POWER CO LTD	48,100	10.730	516,113.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	33.450	140,490.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	16.250	628,875.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	11.210	236,531.000	

BYD CO LTD	10,400	266.590	2,772,536.000	
YOUNGY CO LTD	2,100	105.410	221,361.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	7.690	232,238.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	4.740	161,634.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	47.150	455,469.000	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	50.240	262,252.800	
LB GROUP CO LTD	11,000	19.790	217,690.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	14.460	258,834.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	24.460	205,464.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	57.100	119,910.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	26.900	258,240.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	23.560	275,652.000	
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	6,400	61.100	391,040.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	24.500	196,000.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	23.280	295,656.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,500	230.500	806,750.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	8.560	257,656.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	17.710	226,688.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	7.310	250,002.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	4.690	268,737.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	13.790	76,534.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	3,300	295.760	976,008.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.200	112,320.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	65.510	432,366.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	52.200	31,320.000	
NINESTAR CORP	4,500	53.500	240,750.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	13.300	338,086.000	

GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.040	102,752.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	57.950	92,720.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	15.310	258,739.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	33.590	359,413.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	149.890	272,799.800	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	149.560	269,208.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	6.490	97,999.000	
SF HOLDING CO LTD	32,000	59.100	1,891,200.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	107.330	193,194.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.750	135,700.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	59.690	238,760.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	71.810	179,525.000	
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	4,700	83.340	391,698.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	119,490	5.930	708,575.700	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	6.800	264,520.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	5.220	381,060.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	76.250	175,375.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	24.710	644,931.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	12,180	53.700	654,066.000	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	19.140	174,174.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	33,200	15.960	529,872.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	85.790	265,949.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.160	228,600.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	10,372	43.950	455,849.400	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	9.180	356,184.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	39.750	147,075.000	
CHONGQING FULING ZHACAI	5,200	26.330	136,916.000	

GROUP CO LTD				
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	16.090	245,823.020	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	3,000	134.210	402,630.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	60.000	189,000.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,900	149.000	581,100.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	60.490	163,323.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	57.020	176,762.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	123.560	259,476.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	61.140	557,352.240	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	13.850	131,575.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	28.250	84,750.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	18.760	193,228.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	4,700	51.800	243,460.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	40.340	278,346.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	74.520	338,320.800	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	121.900	365,700.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	55.300	149,310.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	8,030	33.420	268,362.600	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	52.990	68,887.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	66.000	198,000.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	11,600	34.520	400,432.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	34.390	110,048.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.460	94,742.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	87.530	210,072.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	14.770	314,601.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	15.000	198,000.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	4,200	83.730	351,666.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	81.250	154,375.000	

FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	9.400	527,340.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,400	328.090	2,427,866.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.810	121,055.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	4,400	136.200	599,280.000	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	23.780	202,130.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	36.560	148,433.600	
SG MICRO CORP	3,150	166.000	522,900.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	15,700	432.000	6,782,400.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	106.380	320,842.080	
WUXI APPTec CO LTD	17,572	89.530	1,573,221.160	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	36.430	375,229.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	92,100	3.520	324,192.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	55.780	407,194.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	126.500	323,840.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	29,700	12.700	377,190.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	4,950	73.140	362,043.000	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	600	251.100	150,660.000	
BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,900	97.990	284,171.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	208.010	228,811.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	69.780	76,758.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,900	96.780	377,442.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	1,800	95.460	171,828.000	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	100.140	300,420.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	63.460	342,684.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	75,000	4.690	351,750.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	71.510	193,077.000	
ZHEJIANG HANGKE	3,500	46.680	163,380.000	

TECHNOLOGY INC CO				
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	33.730	276,586.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	26,300	11.940	314,022.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	9,130	85.490	780,523.700	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	2,380	111.160	264,560.800	
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	3,220	63.500	204,470.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	26.440	338,432.000	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	43,700	6.820	298,034.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.920	333,756.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	4.950	349,965.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	27.660	295,962.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.550	212,040.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	121.440	267,168.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	1,260	171.230	215,749.800	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	69.450	201,405.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	351.000	280,800.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	960	439.940	422,342.400	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	185,000	4.750	878,750.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.730	225,330.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	64.900	149,270.000	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD	32,900	11.720	385,588.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	8.280	360,180.000	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TECHNOLOGY CO LTD	3,900	60.370	235,443.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	178.700	250,180.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	44.890	273,829.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	43.210	69,136.000	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ	6,300	51.680	325,584.000	

GLASS CO LTD				
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	41.250	247,500.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,200	107.300	236,060.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	17,380	64.830	1,126,745.400	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.490	231,044.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	5,055	136.320	689,097.600	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	9,100	58.390	531,349.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	160.700	417,820.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,500	38.520	288,900.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	54.500	250,700.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	2,900	79.980	231,942.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,600	600.240	960,384.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	2,200	77.620	170,764.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	3,247	272.370	884,385.390	
SHANGHAI MEDICILON INC	800	223.400	178,720.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.300	426,880.000	
PETROCHINA CO LTD	164,900	4.960	817,904.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	373,700	4.300	1,606,910.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	511,200	2.910	1,487,592.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	3.180	623,280.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	227,300	4.370	993,301.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	22,700	36.400	826,280.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	46,200	27.440	1,267,728.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	125,100	38.250	4,785,075.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	62,600	49.210	3,080,546.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	129,900	17.780	2,309,622.000	
SHANGHAI PUDONG	151,300	7.280	1,101,464.000	

DEVELOPMENT BANK CO LTD				
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	217,700	3.430	746,711.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.490	615,825.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	7,900	1,854.450	14,650,155.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	225,700	4.790	1,081,103.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	83,100	20.440	1,698,564.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,700	24.160	983,312.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.240	200,692.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	144,800	20.630	2,987,224.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.530	539,378.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	215,100	3.050	656,055.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	271,500	5.430	1,474,245.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	8.800	488,400.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.210	368,347.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	32,500	32.510	1,056,575.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	166,400	4.230	703,872.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	191,200	4.980	952,176.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	169,900	5.830	990,517.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	28.350	657,720.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	59,800	13.610	813,878.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.380	435,420.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	30.240	353,808.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	88,000	15.900	1,399,200.000	
CRRC CORP LTD	141,700	5.130	726,921.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	43,252	39.380	1,703,263.760	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	30,400	26.510	805,904.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	49,500	12.110	599,445.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	157,500	5.540	872,550.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	16,300	31.710	516,873.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	45,500	25.750	1,171,625.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	16.880	813,616.000	

GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.190	424,447.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	5.600	314,720.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	17,400	35.770	622,398.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	9.540	251,856.000	
GEMDALE CORP	39,700	10.160	403,352.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	20,000	90.900	1,818,000.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	3.990	314,013.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	140,200	11.410	1,599,682.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	32,344	26.200	847,412.800	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	6.050	180,290.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	11,100	231.980	2,574,978.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	11.460	354,114.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.910	424,975.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	106.890	470,316.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.270	81,750.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	102,000	4.770	486,540.000	
AIR CHINA LTD	60,700	10.630	645,241.000	
TBEA CO LTD	18,600	20.080	373,488.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	8.390	364,965.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	164,900	3.190	526,031.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	117,300	7.030	824,619.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	33,700	22.000	741,400.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	58.000	603,200.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	29.830	205,827.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	18.350	273,415.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.800	130,340.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	28,500	17.480	498,180.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	12.190	288,903.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS	11,400	18.400	209,760.000	

HOLDING CO LTD				
AECC AVIATION POWER CO LTD	11,200	41.810	468,272.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.570	605,661.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	13.450	102,220.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	89,670	10.190	913,737.300	
CMOC GROUP LIMITED	119,700	4.830	578,151.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL CO LTD	115,800	3.100	358,980.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	84,800	6.230	528,304.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	44.320	398,880.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	19.900	400,388.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	5,200	31.320	162,864.000	
BBMG CORP	54,200	2.430	131,706.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	14,000	33.020	462,280.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	111,500	5.400	602,100.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	21.880	328,615.720	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.920	343,360.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	26,400	16.820	444,048.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	42.980	441,146.720	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	24.120	391,950.000	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD	127,500	2.430	309,825.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	20.850	68,805.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	96,500	7.840	756,560.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.570	151,630.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	36.320	370,464.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	13.250	250,425.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.370	163,072.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	45.900	211,140.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.690	112,392.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	15,100	25.450	384,295.000	
ZHEJIANG CHINA	49,500	5.040	249,480.000	

COMMODITIES CITY GROUP CO LTD				
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	14,900	14.520	216,348.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.380	172,572.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.210	121,716.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	10.860	253,038.000	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,900	291.640	1,137,396.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	8.810	300,421.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,480	294.000	2,199,120.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	14.900	187,740.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	5.750	326,600.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	7.580	189,500.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	6,500	61.350	398,775.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	16.430	333,529.000	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	10.580	205,252.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	135,800	3.390	460,362.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	10.160	324,104.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	16.820	211,932.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	11.780	307,458.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	37.540	157,668.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.600	277,120.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	33,900	10.710	363,069.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	21.210	269,367.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	23.960	139,686.800	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	11.600	136,880.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	26,800	15.010	402,268.000	
TONGWEI CO LTD	29,000	39.980	1,159,420.000	
SHANGHAI BAOSIGHT	8,879	45.290	402,129.910	

SOFTWARE CO LTD				
JCET GROUP CO LTD	10,900	25.100	273,590.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	33.600	228,480.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	127.550	318,875.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	56.930	301,729.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	15.280	85,568.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	32.810	344,176.900	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	170.620	290,054.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	14.270	288,910.420	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	3.050	190,320.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	18.610	245,652.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	4,524	66.200	299,488.800	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	12.170	238,532.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	16.230	318,108.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	9.960	196,212.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	14.550	228,435.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	106.400	180,880.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	43.570	213,493.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	29.580	165,648.000	
BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	24.400	361,120.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	72.830	305,886.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	6,500	70.450	457,925.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	146.300	131,670.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	800	344.000	275,200.000	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	44.060	114,556.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,000	134.200	134,200.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	365.000	365,000.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	53.780	381,838.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	71.410	792,651.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	181,700	5.870	1,066,579.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	26.770	310,532.000	

SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	97,900	5.910	578,589.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	325.200	325,200.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	600	472.600	283,560.000	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	1,600	224.040	358,464.000	
3PEAK INC	1,200	262.010	314,412.000	
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	4,800	89.450	429,360.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	46,968	42.570	1,999,427.760	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	12.950	164,465.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	135.840	244,512.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	27.780	283,356.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	63,251	19.000	1,201,769.000	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	24,016	80.150	1,924,882.400	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	58.350	291,750.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	35.000	245,000.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	7.960	105,072.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	67.900	475,300.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	22,300	16.460	367,058.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	13.720	558,404.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	5.980	627,900.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	61.680	209,712.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	74.070	392,571.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,000	124.940	249,880.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.420	617,344.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	45,400	13.380	607,452.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	21.550	245,670.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	21.300	42,600.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	28,300	19.890	562,887.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	8,850	43.830	387,895.500	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	9.400	285,760.000	

	TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	155.000	496,000.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	21,300	17.050	363,165.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	10,580	74.500	788,210.000	
	TOLY BREAD CO LTD	7,056	15.640	110,355.840	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	63.390	181,295.400	
	G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	1,000	364.580	364,580.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	48.300	142,002.000	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	19.250	217,717.500	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	10.200	502,860.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.260	244,160.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	54.860	246,870.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	22.280	238,396.000	
オフショア・人民元 小計		15,390,647		245,061,336.490 (4,781,342,724)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	482,352	19.400	9,357,628.800	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	312,267	5.605	1,750,256.530	
	OOREDOO QSC	86,085	9.218	793,531.530	
	QATAR FUEL QSC	67,101	18.690	1,254,117.690	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	49,676	17.800	884,232.800	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	109,350	10.630	1,162,390.500	
	INDUSTRIES QATAR QSC	159,428	14.000	2,231,992.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	165,252	20.850	3,445,504.200	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	249,488	3.780	943,064.640	
	MASRAF AL RAYAN	554,259	3.420	1,895,565.780	
	BARWA REAL ESTATE CO	203,813	3.068	625,298.280	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	451,662	2.272	1,026,176.060	
カタール・リアル 小計		2,890,733		25,369,758.810 (918,892,664)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	766,665	0.820	628,665.300	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	242,238	0.559	135,411.040	
	GULF BANK KSCP	185,675	0.305	56,630.870	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	734,176	1.090	800,251.840	

	SAKP				
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	137,927	0.652	89,928.400	
	MABANEE CO KPSC	68,589	0.837	57,408.990	
	BOUBYAN BANK KSCP	136,266	0.787	107,241.340	
クウェート・ディナール 小計		2,271,536		1,875,537.780 (813,364,469)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	48,542	22,000.000	1,067,924,000.000	
	BANCOLOMBIA SA	29,016	43,050.000	1,249,138,800.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	45,692	34,500.000	1,576,374,000.000	
コロンビア・ペソ 小計		123,250		3,893,436,800.000 (107,610,700)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,055	41.500	1,081,282.500	
	JARIR MARKETING CO	6,127	151.600	928,853.200	
	ETIHAD ETISALAT CO	38,569	36.200	1,396,197.800	
	SAUDI BRITISH BANK	92,679	37.500	3,475,462.500	
	AL RAJHI BANK	204,748	75.900	15,540,373.200	
	ARAB NATIONAL BANK	58,412	30.500	1,781,566.000	
	BANK ALBILAD	47,980	45.050	2,161,499.000	
	BANK AL-JAZIRA	41,743	19.180	800,630.740	
	BANQUE SAUDI FRANSI	62,154	39.650	2,464,406.100	
	RIYAD BANK	136,011	30.750	4,182,338.250	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,554	18.000	945,972.000	
	SAUDI TELECOM CO	157,136	37.900	5,955,454.400	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	21,953	144.800	3,178,794.400	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	94,642	93.500	8,849,027.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	87,342	23.600	2,061,271.200	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	38,856	23.380	908,453.280	
	SAVOLA GROUP	30,777	28.300	870,989.100	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	24,022	12.660	304,118.520	
	ALMARAI CO JSC	23,932	53.900	1,289,934.800	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,987	186.000	741,582.000	
	EMAAR ECONOMIC CITY	53,833	8.420	453,273.860	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	33,939	34.500	1,170,895.500	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	14,397	44.000	633,468.000	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	75,912	13.700	1,039,994.400	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	59,592	12.040	717,487.680		
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	52,677	11.040	581,554.080		

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	53,271	10.700	569,999.700	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	8,157	144.600	1,179,502.200	
	ALINMA BANK	98,225	32.300	3,172,667.500	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	87,447	73.300	6,409,865.100	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,036	211.800	1,066,624.800	
	DALLAH HEALTHCARE CO	4,127	144.000	594,288.000	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	254,633	31.850	8,110,061.050	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	8,510	223.800	1,904,538.000	
	ACWA POWER CO	7,940	161.000	1,278,340.000	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,627	242.600	637,310.200	
	NAHDI MEDICAL CO	4,279	170.600	729,997.400	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	5,202	185.000	962,370.000	
	ELM CO	2,420	331.600	802,472.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	229,007	49.100	11,244,243.700	
サウジアラビア・リアル	小計	2,310,910		102,177,159.160 (3,610,940,805)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	148,800	36.500	5,431,200.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	419,600	18.100	7,594,760.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	124,300	44.500	5,531,350.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,414,455	4.880	6,902,540.400	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	66,300	155.500	10,309,650.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	29,400	177.000	5,203,800.000	
	SHIN CORP PCL	127,600	76.000	9,697,600.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	392,200	24.000	9,412,800.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	118,700	203.000	24,096,100.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	666,020	15.800	10,523,116.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	31,700	832.000	26,374,400.000	
	PTT PCL	1,061,900	33.250	35,308,175.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	265,000	16.400	4,346,000.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	83,100	58.750	4,882,125.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	826,100	9.850	8,137,085.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	82,050	358.000	29,373,900.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	429,100	75.250	32,289,775.000	

	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	193,400	70.000	13,538,000.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,097,500	30.750	33,748,125.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	62,700	225.000	14,107,500.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	328,110	33.750	11,073,712.500	
	THAI OIL PCL NVDR	124,700	55.500	6,920,850.000	
	CP ALL PCL NVDR	588,600	71.000	41,790,600.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	866,900	8.600	7,455,340.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	138,845	169.000	23,464,805.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	189,722	41.250	7,826,032.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	234,908	50.250	11,804,127.000	
	JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	54,300	68.750	3,733,125.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	167,600	91.000	15,251,600.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	860,800	9.600	8,263,680.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	98,200	41.500	4,075,300.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	291,000	55.000	16,005,000.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	142,800	30.000	4,284,000.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	817,200	6.150	5,025,780.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	203,033	44.750	9,085,726.750	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	143,300	58.000	8,311,400.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	69,000	53.000	3,657,000.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	295,300	24.000	7,087,200.000	
	SCB X PCL NVDR	90,300	113.500	10,249,050.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	32,500	102.500	3,331,250.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	55,400	41.250	2,285,250.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	74,400	74.750	5,561,400.000	
	タイ・パーツ 小計	13,506,843		513,350,230.150 (2,022,599,907)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,062	725.000	5,844,950.000	
	CEZ	17,008	802.000	13,640,416.000	
	MONETA MONEY BANK AS	40,915	80.700	3,301,840.500	
チェコ・コルナ	小計	65,985		22,787,206.500 (135,153,200)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,868,510	33.450	229,751,659.500	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	5,709	24,300.000	138,728,700.000	
	BANCO DE CHILE	4,614,110	83.490	385,232,043.900	

	EMPRESAS CMPC SA	119,258	1,469.000	175,190,002.000	
	EMPRESAS COPEC SA	40,423	6,150.000	248,601,450.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,516	5,615.000	59,047,340.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,882,457	67.360	126,802,303.520	
	ENEL AMERICAS SA	2,133,152	110.000	234,646,720.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	14,822	67,000.000	993,074,000.000	
	FALABELLA SA	80,736	1,799.000	145,244,064.000	
	CENCOSUD SA	152,261	1,300.000	197,939,300.000	
	ENEL CHILE SA	2,415,702	36.900	89,139,403.800	
チリ・ペソ 小計		18,337,656		3,023,396,986.720 (483,029,996)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	335,192	17.030	5,708,319.760	
	AELSAN ELEKTRONIK SANAYI	73,827	58.150	4,293,040.050	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	147,123	37.860	5,570,076.780	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,410	479.000	3,549,390.000	
	HEKTAS TICARET TAS	121,118	34.000	4,118,012.000	
	KOC HOLDING AS	71,598	72.250	5,172,955.500	
	SASA POLYESTER SANAYI	46,986	101.000	4,745,586.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	144,586	40.840	5,904,892.240	
	TURK HAVA YOLLARI	57,648	131.200	7,563,417.600	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	137,757	35.840	4,937,210.880	
	TURKIYE IS BANKASI	315,842	11.180	3,531,113.560	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,554	475.300	6,442,216.200	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	313,727	9.530	2,989,818.310	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	92,361	40.180	3,711,064.980	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	48,467	130.000	6,300,710.000		
トルコ・リラ 小計		1,927,196		74,537,823.860 (525,417,120)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	13,796	8,550.000	117,955,800.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	40,781	2,680.000	109,293,080.000	
	OTP BANK NYRT	22,296	10,920.000	243,472,320.000	
ハンガリー・フォリント 小計		76,873		470,721,200.000 (168,103,014)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	755,500	30.000	22,665,000.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	158,120	59.000	9,329,080.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	188,130	104.500	19,659,585.000	

	AYALA CORP	27,283	703.000	19,179,949.000	
	GLOBE TELECOM INC	3,335	2,114.000	7,050,190.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	96,370	203.000	19,563,110.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	318,290	56.200	17,887,898.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	46,960	241.000	11,317,360.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	205,155	57.200	11,734,866.000	
	BDO UNIBANK INC	230,062	110.900	25,513,875.800	
	PLDT INC	8,985	1,433.000	12,875,505.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,194,575	37.250	44,497,918.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	96,820	138.000	13,361,160.000	
	SM INVESTMENTS CORP	24,133	903.500	21,804,165.500	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,720	306.000	7,564,320.000	
	ACEN CORP	763,119	7.300	5,570,768.700	
	MONDE NISSIN CORP	649,200	12.300	7,985,160.000	
	フィリピン・ペソ 小計	4,790,757		277,559,911.750 (669,446,751)	
ブラジル・リアル	BRF SA	54,692	9.060	495,509.520	
	VALE SA	396,789	93.580	37,131,514.620	
	RAIA DROGASIL SA	106,600	24.010	2,559,466.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,950	42.190	1,010,450.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	124,000	40.900	5,071,600.000	
	BANCO DO BRASIL SA	87,800	35.300	3,099,340.000	
	ITAUSA SA	544,626	8.720	4,749,138.720	
	GERDAU SA	114,630	31.810	3,646,380.300	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	388,910	27.250	10,597,797.500	
	VIBRA ENERGIA SA	116,600	14.890	1,736,174.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	490,912	24.090	11,826,070.080	
	CCR SA	121,020	10.870	1,315,487.400	
	WEG SA	171,244	37.550	6,430,212.200	
	BANCO BRADESCO SA PREF	545,102	15.100	8,231,040.200	
	BANCO BRADESCO SA	176,892	13.190	2,333,205.480	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	64,606	17.120	1,106,054.720	
	SUZANO SA	74,375	49.980	3,717,262.500	
	CPFL ENERGIA SA	23,600	31.740	749,064.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	504,947	25.900	13,078,127.300	
	AMERICANAS SA	69,171	11.910	823,826.610	
	BRASKEM SA	19,900	23.050	458,695.000	
	ENGIE BRASIL SA	25,587	37.850	968,467.950	
	LOCALIZA RENT A CAR	79,789	53.580	4,275,094.620	
	LOJAS RENNER SA	93,720	20.020	1,876,274.400	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	66,304	12.720	843,386.880	
	COSAN SA	127,900	17.050	2,180,695.000	
	TOTVS SA	53,400	28.830	1,539,522.000	

	EQUATORIAL ENERGIA SA	110,600	26.180	2,895,508.000	
	JBS SA	83,500	22.650	1,891,275.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	137,962	11.220	1,547,933.640	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	38,498	55.190	2,124,704.620	
	HYPERA SA	41,200	43.250	1,781,900.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	626,548	12.860	8,057,407.280	
	MAGAZINE LUIZA SA	271,500	3.050	828,075.000	
	HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	70,900	36.210	2,567,289.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	50,528	38.500	1,945,328.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	77,500	34.200	2,650,500.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	468,661	4.310	2,019,928.910	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	73,400	14.700	1,078,980.000	
	AMBEV SA	501,895	14.540	7,297,553.300	
	NATURA &CO HOLDING SA	92,700	12.590	1,167,093.000	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	348	11.980	4,169.040	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	88,800	19.240	1,708,512.000	
	TIM SA	97,900	11.870	1,162,073.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	60,700	27.100	1,644,970.000	
	RUMO SA	144,300	18.130	2,616,159.000	
	ブラジル・リアル 小計	7,704,506		176,839,216.290 (4,496,667,592)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	356.000	478,464.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,187	150.850	2,290,958.950	
	BANK PEKAO SA	20,059	99.800	2,001,888.200	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	67,889	62.000	4,209,118.000	
	LPP SA	112	12,530.000	1,403,360.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,927	298.800	1,173,387.600	
	CD PROJEKT RED SA	7,001	138.160	967,258.160	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	85,944	35.000	3,008,040.000	
	CYFROWY POLSAT SA	33,104	19.070	631,293.280	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	113,003	6.668	753,504.000	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	58,500	36.920	2,159,820.000	
	DINO POLSKA SA	4,692	365.000	1,712,580.000	
	ALLEGRO. EU SA	40,496	28.910	1,170,739.360	
	PEPCO GROUP NV	16,587	41.560	689,355.720	

ポーランド・ズロチ	小計	467,845		22,649,767.270 (686,573,335)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	210,200	4.160	874,432.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	680,800	5.720	3,894,176.000	
	DIGI.COM BHD	338,100	3.980	1,345,638.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	88,020	7.000	616,140.000	
	RHB BANK BHD	169,380	5.720	968,853.600	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	60,000	6.710	402,600.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	500,700	0.850	425,595.000	
	GENTING BHD	250,100	4.800	1,200,480.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,056	18.580	335,480.480	
	HONG LEONG BANK BHD	65,508	20.600	1,349,464.800	
	IOI CORP BHD	276,613	3.960	1,095,387.480	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	48,500	21.960	1,065,060.000	
	MALAYAN BANKING BHD	507,475	8.790	4,460,705.250	
	MISC BHD	147,380	7.300	1,075,874.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,300	137.500	866,250.000	
	PPB GROUP BHD	70,260	17.520	1,230,955.200	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	34,400	22.740	782,256.000	
	PETRONAS GAS BHD	79,500	17.160	1,364,220.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	254,200	2.800	711,760.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	142,900	5.200	743,080.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	270,750	9.530	2,580,247.500	
	QL RESOURCES BHD	115,450	5.800	669,610.000	
	DIALOG GROUP BHD	418,344	2.550	1,066,777.200	
	PUBLIC BANK BHD (LOCAL)	1,475,450	4.300	6,344,435.000	
	SIME DARBY BERHAD	320,700	2.290	734,403.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	249,800	1.570	392,186.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	317,100	2.900	919,590.000	
MAXIS BHD	206,000	3.740	770,440.000		
INARI AMERTRON BHD	330,600	2.640	872,784.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	232,000	8.300	1,925,600.000		
IHH HEALTHCARE BHD	177,700	6.030	1,071,531.000		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	376,100	4.920	1,850,412.000		
SIME DARBY PLANTATION BHD	220,800	4.370	964,896.000		
MR DIY GROUP M BHD	259,200	2.040	528,768.000		
マレーシア・リンギット	小計	8,918,386		45,500,087.510 (1,377,019,198)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	338,400	13.600	4,602,240.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	130,400	90.380	11,785,552.000	
	GRUMA SAB DE CV	21,700	270.430	5,868,331.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,660	176.490	3,999,263.400	

	GRUPO CARSO SAB DE CV	48,500	87.520	4,244,720.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	268,700	153.420	41,223,954.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	121,125	38.430	4,654,833.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,975	292.750	4,676,681.250	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	170,000	34.910	5,934,700.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	18,755	497.440	9,329,487.200	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	313,552	82.870	25,984,054.240	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,871,978	18.820	54,050,625.960	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	219,900	35.400	7,784,460.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,700	161.530	7,220,391.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	546,700	72.170	39,455,339.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	34,865	320.090	11,159,937.850	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	101,400	22.650	2,296,710.000	
	BANCO DEL BAJIO SA	85,300	65.970	5,627,241.000	
メキシコ・ペソ	小計	5,374,610		249,898,521.650 (1,736,469,857)	
ユーロ	ALPHA BANK A. E.	235,597	1.140	268,580.580	
	NATIONAL BANK OF GREECE	62,656	3.948	247,365.880	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,850	14.600	304,410.000	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	240,441	1.142	274,583.620	
	MYTILINEOS HOLDINGS	10,944	20.060	219,536.640	
	OPAP SA	21,952	13.260	291,083.520	
	JUMBO SA	12,011	15.840	190,254.240	
	PUBLIC POWER CORP	21,441	7.140	153,088.740	
	TERNA ENERGY SA	6,102	20.420	124,602.840	
ユーロ	小計	635,124		2,073,506.060 (294,956,237)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	2,357	92,700.000	218,493,900.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	8,603	22,600.000	194,427,800.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,498	79,900.000	279,490,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,979	201,000.000	598,779,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,051	65,400.000	330,335,400.000	
	COWAY CO LTD	5,833	55,100.000	321,398,300.000	
	KT&G CORP	11,192	91,700.000	1,026,306,400.000	
	S-1 CORPORATION	1,557	59,500.000	92,641,500.000	

CJ CORP	1,958	82,800.000	162,122,400.000	
KAKAO CORP	32,040	60,700.000	1,944,828,000.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,228	6,650.000	207,666,200.000	
NCSOFT CORPORATION	1,670	454,000.000	758,180,000.000	
LG UPLUS CORP	25,277	10,850.000	274,255,450.000	
DOOSAN ENERBILITY	44,086	16,400.000	723,010,400.000	
LG H&H CO LTD	981	743,000.000	728,883,000.000	
LG CHEM LTD	5,096	629,000.000	3,205,384,000.000	
LG CHEM LTD	733	287,000.000	210,371,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	46,638	40,900.000	1,907,494,200.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	25,738	20,050.000	516,046,900.000	
S-OIL CORP	4,649	81,600.000	379,358,400.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,729	43,750.000	556,893,750.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	30,993	6,100.000	189,057,300.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,276	34,200.000	214,639,200.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,016	188,500.000	568,516,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,896	185,500.000	351,708,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,641	83,600.000	304,387,600.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,383	74,900.000	328,286,700.000	
HYUNDAI MOBIS	6,285	217,500.000	1,366,987,500.000	
SK HYNIX INC	56,210	86,500.000	4,862,165,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	8,580	38,350.000	329,043,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,064	77,800.000	160,579,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	14,554	163,000.000	2,372,302,000.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,694	75,300.000	202,858,200.000	
HYUNDAI STEEL CO	9,701	33,350.000	323,528,350.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,033	10,150.000	284,534,950.000	
KIA CORPORATION	27,279	63,900.000	1,743,128,100.000	
KOREA ZINC CO LTD	943	547,000.000	515,821,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,475	19,700.000	482,157,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	19,941	23,700.000	472,601,700.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,003	140,500.000	281,421,500.000	
HLB INC	12,499	30,750.000	384,344,250.000	
LG ELECTRONICS INC	10,636	95,100.000	1,011,483,600.000	
LG CORP	9,486	78,800.000	747,496,800.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,290	9,190.000	140,515,100.000	
NAVER CORP	13,545	193,000.000	2,614,185,000.000	
L&F CO LTD	2,630	181,700.000	477,871,000.000	
KOREA INVESTMENT	4,934	59,200.000	292,092,800.000	

HOLDINGS CO LTD				
KANGWON LAND INC	9,245	23,800.000	220,031,000.000	
POSCO HOLDINGS INC	7,980	291,000.000	2,322,180,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16,885	24,350.000	411,149,750.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,633	612,000.000	3,447,396,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,494	146,500.000	804,871,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	495,712	60,400.000	29,941,004,800.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	68,830	5,060.000	348,279,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	86,098	55,000.000	4,735,390,000.000	
YUHAN CORP	6,167	55,200.000	340,418,400.000	
HANON SYSTEMS	19,141	8,680.000	166,143,880.000	
GS HOLDINGS CORP	4,259	43,250.000	184,201,750.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,742	13,450.000	319,329,900.000	
CELLTRION INC	10,474	165,000.000	1,728,210,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	29,840	49,400.000	1,474,096,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,928	167,500.000	322,940,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,764	64,500.000	113,778,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,025	97,300.000	99,732,500.000	
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	3,912	47,450.000	185,624,400.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	7,704	71,100.000	547,754,400.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,032	140,000.000	424,480,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,862	148,500.000	870,507,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	890	341,500.000	303,935,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	31,293	5,540.000	173,363,220.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,436	275,500.000	395,618,000.000	
SK INC	3,619	189,500.000	685,800,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	39,949	57,800.000	2,309,052,200.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,426	44,400.000	329,714,400.000	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,508	56,200.000	140,949,600.000	
HANMI PHARM CO LTD	810	265,000.000	214,650,000.000	
E-MART CO LTD	1,730	100,500.000	173,865,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,697	32,150.000	247,458,550.000	
HD HYUNDAI CO LTD	5,382	56,500.000	304,083,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	715	189,500.000	135,492,500.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,129	122,000.000	259,738,000.000	
NETMARBLE CORP	2,597	54,000.000	140,238,000.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	55,475	12,700.000	704,532,500.000	
ECOPRO BM CO LTD	5,510	96,500.000	531,715,000.000	
SD BIOSENSOR INC	4,288	30,300.000	129,926,400.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO	2,949	73,800.000	217,636,200.000	

	LTD				
	KRAFTON INC	3,153	171,500.000	540,739,500.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	2,064	106,500.000	219,816,000.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,720	58,500.000	159,120,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	10,144	35,150.000	356,561,600.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,779	77,200.000	214,538,800.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	43,550.000	142,147,200.000	
	HYBE CO LTD	1,920	170,500.000	327,360,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORP-RTS	366	45,550.000	16,671,300.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,656	473,500.000	1,731,116,000.000	
	KAKAOBANK CORP	15,775	28,350.000	447,221,250.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,875	134,000.000	251,250,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,640	124,500.000	453,180,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,441	117,500.000	991,817,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,858	799,000.000	1,484,542,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	3,427	41,800.000	143,248,600.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,600	34,200.000	157,320,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	9,033	57,100.000	515,784,300.000	
	韓国・ウォン 小計	1,665,725		100,215,798,250.000 (10,662,960,934)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	131,000	12.640	1,655,840.000	
	JIANGSU EXPRESS	144,000	7.210	1,038,240.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	206,000	5.490	1,130,940.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12,000	135.590	1,627,080.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	123,000	29.250	3,597,750.000	
	BEIJING ENTERPRISES	58,000	26.600	1,542,800.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	390,000	4.150	1,618,500.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	496,000	7.670	3,804,320.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	154,000	23.950	3,688,300.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	67,500	40.950	2,764,125.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	897,600	8.650	7,764,240.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	384,620	22.000	8,461,640.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	326,888	37.850	12,372,710.800	
	CITIC LTD	572,000	8.380	4,793,360.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	234,000	6.350	1,485,900.000	
	LENOVO GROUP LTD	772,000	6.440	4,971,680.000	
	PETRO CHINA CO LTD	2,136,000	3.580	7,646,880.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE	170,790	10.360	1,769,384.400	

HOLDINGS CO LTD				
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONIC	29,000	33.900	983,100.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,577,200	3.840	9,896,448.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	106,000	17.800	1,886,800.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	257,000	16.940	4,353,580.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	80,400	119.700	9,623,880.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	358,000	6.090	2,180,220.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	216,000	6.420	1,386,720.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	152,200	10.960	1,668,112.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	162,000	11.600	1,879,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	380,000	3.760	1,428,800.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	130,500	7.810	1,019,205.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	287,800	11.940	3,436,332.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	73,500	27.500	2,021,250.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	627,000	12.360	7,749,720.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	88,200	34.200	3,016,440.000	
BYD CO LTD	87,000	207.200	18,026,400.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	200,000	9.700	1,940,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	411,592	3.530	1,452,919.760	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	300,000	7.270	2,181,000.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	13,000	138.800	1,804,400.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	723,788	7.350	5,319,841.800	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.690	808,110.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	193,200	17.100	3,303,720.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	314,000	10.680	3,353,520.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	753,000	14.240	10,722,720.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	571,000	12.420	7,091,820.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	256,000	13.020	3,333,120.000	
WEICHAI POWER CO LTD	189,440	11.280	2,136,883.200	
TINGYI HOLDING CORP	202,000	13.380	2,702,760.000	

TSINGTAO BREWERY CO LTD	66,000	80.200	5,293,200.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	332,000	8.730	2,898,360.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	316,000	3.930	1,241,880.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	167,333	60.000	10,039,980.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	100,000	6.450	645,000.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,022,250	4.770	4,876,132.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	323,000	37.400	12,080,200.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	648,100	362.400	234,871,440.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	659,000	56.750	37,398,250.000	
LI NING CO LTD	244,000	74.150	18,092,600.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	522,000	2.070	1,080,540.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	543,000	3.670	1,992,810.000	
AIR CHINA / HONG KONG	196,000	7.280	1,426,880.000	
ZTE CORP	91,288	18.000	1,643,184.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	339,000	23.250	7,881,750.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	354,250	7.980	2,826,915.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	906,205	4.720	4,277,287.600	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	216,250	8.480	1,833,800.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	85,000	17.300	1,470,500.000	
BAIDU INC	229,350	130.600	29,953,110.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,981,530	4.990	49,807,834.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	85,600	97.200	8,320,320.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	334,000	4.600	1,536,400.000	
MINTH GROUP LTD	82,000	22.000	1,804,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	7.740	1,253,880.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	370,000	7.010	2,593,700.000	
BANK OF CHINA LTD	8,265,200	2.900	23,969,080.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	84,000	12.320	1,034,880.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	410,470	46.250	18,984,237.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,857,235	4.140	24,248,952.900	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	137,000	9.420	1,290,540.000	

KINGBOARD LAMINATES HOLDING	112,500	8.730	982,125.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	285,600	3.060	873,936.000	
CHINA COAL ENERGY CO	209,000	6.260	1,308,340.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	74,000	22.000	1,628,000.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	53,500	40.250	2,153,375.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	1,280,142	2.900	3,712,411.800	
CMOC GROUP LIMITED	393,000	3.890	1,528,770.000	
CHINA CITIC BANK-H	987,800	3.610	3,565,958.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	72,700	95.650	6,953,755.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	125,000	108.000	13,500,000.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	24.700	864,500.000	
FOSUN INTERNATIONAL	288,028	6.810	1,961,470.680	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	1.830	1,021,140.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	392,000	4.300	1,685,600.000	
KINGSOFT CORP LTD	98,800	29.550	2,919,540.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,145,000	2.110	4,525,950.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	469,000	4.180	1,960,420.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	152,000	7.830	1,190,160.000	
DONGYUE GROUP	159,000	9.330	1,483,470.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	71,000	25.300	1,796,300.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	492,000	5.380	2,646,960.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	282,200	18.640	5,260,208.000	
CRRC CORP LTD - H	487,000	3.350	1,631,450.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	154,500	9.390	1,450,755.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	143,000	13.220	1,890,460.000	
SINOPHARM GROUP CO	140,400	19.840	2,785,536.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	192,000	4.490	862,080.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	290,527	5.640	1,638,572.280	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	257,500	8.160	2,101,200.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	344,000	11.300	3,887,200.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	61,300	13.840	848,392.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY	210,600	16.940	3,567,564.000	

GROUP LTD				
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	99,000	8.250	816,750.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	196,000	26.050	5,105,800.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	88,300	21.600	1,907,280.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	2.820	1,771,399.920	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	62,200	7.820	486,404.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	106,000	9.100	964,600.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.450	556,150.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	3,054,000	2.750	8,398,500.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	61,500	47.650	2,930,475.000	
FAR EAST HORIZON LTD	188,000	6.570	1,235,160.000	
MICROPORIT SCIENTIFIC CORP	61,200	22.050	1,349,460.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	219,500	17.060	3,744,670.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	343,200	5.150	1,767,480.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	836,000	2.650	2,215,400.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	26.300	1,209,800.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	348,000	4.050	1,409,400.000	
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	176,000	5.720	1,006,720.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	834,000	5.330	4,445,220.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	57,000	31.950	1,821,150.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	114,000	25.700	2,929,800.000	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	42,500	62.350	2,649,875.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	228,000	20.750	4,731,000.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,100	23.350	1,309,935.000	

SHANDONG GOLD MINING CO LTD	88,000	15.460	1,360,480.000
CHINA TOWER CORP LTD	4,292,000	0.890	3,819,880.000
XIAOMI CORP	1,560,400	11.980	18,693,592.000
BEIGENE LTD	63,000	150.100	9,456,300.000
WUXI APPTec CO LTD	36,912	93.200	3,440,198.400
MEITUAN	526,110	178.500	93,910,635.000
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	128,000	18.820	2,408,960.000
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	124,000	24.050	2,982,200.000
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	490,000	9.800	4,802,000.000
INNOVENT BIOLOGICS INC	103,000	37.600	3,872,800.000
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	997,000	1.160	1,156,520.000
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	44,000	18.160	799,040.000
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	176,500	16.440	2,901,660.000
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	152,000	7.470	1,135,440.000
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	128,000	17.700	2,265,600.000
CHINA FEIHE LTD	374,000	8.250	3,085,500.000
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,538,668	109.500	168,484,146.000
PHARMARON BEIJING CO LTD	19,300	58.500	1,129,050.000
HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS LTD	351,000	1.780	624,780.000
JD.COM INC	223,735	250.000	55,933,750.000
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	184,000	14.000	2,576,000.000
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	251.400	1,910,640.000
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	69,000	22.900	1,580,100.000
KUAISHOU TECHNOLOGY	182,100	77.750	14,158,275.000
HAIER SMART HOME CO LTD	228,400	28.900	6,600,760.000
BILIBILI INC	19,420	214.400	4,163,648.000
NETEASE INC	202,700	127.100	25,763,170.000
GDS HOLDINGS LTD	90,500	23.400	2,117,700.000
NONGFU SPRING CO LTD	177,000	44.250	7,832,250.000
LI AUTO INC	116,000	88.550	10,271,800.000
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	112,850	73.300	8,271,905.000
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	38,400	59.250	2,275,200.000
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	69,200	44.200	3,058,640.000
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12,600	94.900	1,195,740.000

	CHINA VANKE CO LTD-H	174,661	17.000	2,969,237.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	150,400	31.400	4,722,560.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	49,600	25.300	1,254,880.000	
	XPENG INC	93,600	40.650	3,804,840.000	
	SUPER HI INTERNATIONAL HOLDING LTD	12,400	13.920	172,608.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	65,000	30.200	1,963,000.000	
	CGN POWER CO LTD	1,043,000	1.890	1,971,270.000	
	GF SECURITIES CO LTD	106,000	11.940	1,265,640.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	61,600	35.250	2,171,400.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	149,400	9.470	1,414,818.000	
	3SBIO INC	146,500	8.590	1,258,435.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	182,500	5.850	1,067,625.000	
	CHINA LITERATURE LTD	38,600	39.350	1,518,910.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	43,000	23.050	991,150.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	261,500	3.640	951,860.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	145,000	10.460	1,516,700.000	
	BOC AVIATION LTD	23,600	65.400	1,543,440.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	61,700	26.100	1,610,370.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	15.620	1,936,880.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	144,000	16.340	2,352,960.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	376,500	67.400	25,376,100.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	436,000	2.030	885,080.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	37,240	61.650	2,295,846.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	70,000	23.750	1,662,500.000	
	香港・ドル 小計	87,680,228		1,384,772,852.240 (23,471,899,847)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,906	253.000	12,373,218.000	
	ACER INC	257,385	24.000	6,177,240.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	76,387	269.500	20,586,296.500	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,734	323.500	15,118,449.000	
	ASIA CEMENT CORP	236,105	41.800	9,869,189.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	665,088	13.350	8,878,924.800	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	96,000	91.700	8,803,200.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	70,000	126.500	8,855,000.000	

UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	133,577	126.500	16,897,490.500	
QUANTA COMPUTER INC	288,704	74.000	21,364,096.000	
EVA AIRWAYS CORP	255,000	28.300	7,216,500.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	65,760	177.500	11,672,400.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	435,421	17.550	7,641,638.550	
CHINA AIRLINES	290,000	19.100	5,539,000.000	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	178,169	34.850	6,209,189.650	
CHINA STEEL CORP	1,208,550	30.850	37,283,767.500	
ADVANTECH CO LTD	46,107	346.000	15,953,022.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	390,291	23.250	9,074,265.750	
DELTA ELECTRONICS INC	198,397	283.500	56,245,549.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	134,000	56.500	7,571,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	396,170	115.000	45,559,550.000	
AUO CORP	618,649	16.000	9,898,384.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	168,100	98.300	16,524,230.000	
EVERGREEN MARINE CORP	108,427	155.500	16,860,398.500	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	301,339	32.300	9,733,249.700	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	44,768	210.000	9,401,280.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	19,322	487.000	9,409,814.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,144	347.000	20,175,968.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	428,320	88.900	38,077,648.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	357,733	72.500	25,935,642.500	
GIANT MANUFACTURING	31,244	201.000	6,280,044.000	
MEDIATEK INC	158,073	694.000	109,702,662.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	769,272	59.200	45,540,902.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	926,468	23.500	21,771,998.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	31,875	637.000	20,304,375.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	165,000	68.000	11,220,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,054,424	22.600	23,829,982.400	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	895,649	41.700	37,348,563.300	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,644,723	13.000	21,381,399.000	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,305,380	24.500	31,981,810.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,303,150	99.400	129,533,110.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING	1,163,734	31.750	36,948,554.500	

CO LTD				
LARGAN PRECISION CO LTD	10,527	2,180.000	22,948,860.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,169,529	15.700	18,361,605.300	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,245,381	8.970	11,171,067.570	
INVENTEC CO LTD	270,005	26.550	7,168,632.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	191,335	66.100	12,647,243.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,095,163	17.400	19,055,836.200	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,823,942	23.150	42,224,257.300	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,068,224	27.100	28,948,870.400	
NAN YA PLASTICS CORP	494,529	74.500	36,842,410.500	
POU CHEN CORP	233,990	34.250	8,014,157.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	497,113	67.100	33,356,282.300	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	60,771	276.000	16,772,796.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,706	82.600	9,309,515.600	
E INK HOLDINGS INC	83,920	173.500	14,560,120.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	174,336	43.300	7,548,748.800	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	151,509	60.100	9,105,690.900	
TAIWAN CEMENT CORP	656,781	34.600	22,724,622.600	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,555,294	486.000	1,241,872,884.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,230,318	45.000	55,364,310.000	
WAN HAI LINES LTD	78,747	76.500	6,024,145.500	
WALSIN LIHWA CORP	246,163	47.200	11,618,893.600	
WINBOND ELECTRONICS CORP	258,059	20.900	5,393,433.100	
YAGEO CORP	37,651	535.000	20,143,285.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	165,608	62.900	10,416,743.200	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	193,000	29.300	5,654,900.000	
INNOLUX CORPORATION	910,742	11.750	10,701,218.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	165,203	48.000	7,929,744.000	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	26,098	236.500	6,172,177.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,995	1,505.000	10,527,475.000	
PEGATRON CORP	191,880	64.500	12,376,260.000	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,928	982.000	14,659,296.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	39,402	176.000	6,934,752.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	145,886	233.000	33,991,438.000	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	957.000	7,656,000.000	

	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	72,362	108.000	7,815,096.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	1,002,944	27.000	27,079,488.000	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	383,437	46.150	17,695,617.550	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	7,029	1,650.000	11,597,850.000	
	WIWYNN CORP	10,133	776.000	7,863,208.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	332,527	101.500	33,751,490.500	
	SILERGY CORP	33,108	519.000	17,183,052.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	326,209	34.000	11,091,106.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	20,576	457.500	9,413,520.000	
	MOMO.COM INC	6,600	737.000	4,864,200.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	23,884	470.000	11,225,480.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	20,508	308.000	6,316,464.000	
	台湾・ドル 小計	34,923,597		2,944,843,246.220 (12,792,104,577)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	10,000	311.800	3,118,000.000	
	BIDVEST GROUP LTD	27,847	220.590	6,142,769.730	
	CLICKS GROUP LTD	24,286	282.780	6,867,595.080	
	DISCOVERY LTD	49,120	131.940	6,480,892.800	
	GOLD FIELDS LTD	89,222	205.500	18,335,121.000	
	REMGRO LTD	54,645	135.650	7,412,594.250	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,991	108.000	3,563,028.000	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	60,894	67.730	4,124,350.620	
	EXXARO RESOURCES LTD	24,734	221.590	5,480,807.060	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,969	1,895.930	17,004,596.170	
	MTN GROUP LTD	174,803	128.900	22,532,106.700	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,096	371.780	16,394,010.880	
	FIRSTRAND LTD	529,869	63.020	33,392,344.380	
	NASPERS LTD	22,668	3,236.010	73,353,874.680	
	NEDBANK GROUP LTD	48,729	213.650	10,410,950.850	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,841	1,473.750	8,608,173.750	
	SASOL LTD	58,516	280.030	16,386,235.480	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	52,979	238.800	12,651,385.200	
	MR PRICE GROUP LTD	26,025	168.410	4,382,870.250	
	STANDARD BANK GROUP LTD	142,458	169.780	24,186,519.240	
	SPAR GROUP LTD/THE	21,004	128.510	2,699,224.040	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	99,816	69.250	6,912,258.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	38,563	139.860	5,393,421.180		
ABSA GROUP LTD	86,956	198.470	17,258,157.320		

	SANLAM LTD	189,923	52.340	9,940,569.820	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	88,373	232.430	20,540,536.390	
	KUMBA IRON ORE LTD	7,079	539.000	3,815,581.000	
	VODACOM GROUP PTY LTD	69,076	123.520	8,532,267.520	
	NEPI ROCKCASTLE NV	51,129	105.450	5,391,553.050	
	OLD MUTUAL LTD	479,238	11.280	5,405,804.640	
	REINET INVESTMENTS SCA	12,515	332.970	4,167,119.550	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	166,142	20.530	3,410,895.260	
	MULTICHOICE GROUP LTD	34,585	120.860	4,179,943.100	
	SIBANYE STILLWATER LTD	280,877	51.420	14,442,695.340	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	32,404	204.430	6,624,349.720	
	BID CORP LTD	35,633	350.730	12,497,562.090	
	南アフリカ・ランド 小計	3,182,005		432,040,164.140 (3,365,592,879)	
	合計	573,310,273		91,379,149,211 (91,379,149,211)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	126,200.000	2,983,368.000		
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	38,000.000	1,162,800.000		
		ENERGISA SA	24,300.000	1,008,207.000		
		KLABIN SA	78,200.000	1,584,332.000		
	ブラジル・リアル 小計			266,700.000	6,738,707.000 (171,351,842)	
	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,625,775.000	13,997,922.750	
			COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	54,600.000	7,147,686.000	
			FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	199,700.000	30,685,902.000	
			GRUPO TELEVISIA SAB	246,900.000	4,841,709.000	
	メキシコ・ペソ 小計			2,126,975.000	56,673,219.750 (393,805,202)	
投資信託受益証券 合計			2,393,675	565,157,044 (565,157,044)		
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	296,300.000	7,229,720.000		
		メキシコ・ペソ 小計		296,300.000	7,229,720.000 (50,237,154)	
	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	380,859.000	5,598,627.300	
			南アフリカ・ランド 小計		380,859.000	5,598,627.300 (43,613,307)
投資証券 合計			677,159	93,850,461 (93,850,461)		
合計				659,007,505		

(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 49銘柄	2.90	—	—	3.11
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.19	—	—	1.27
インド・ルピー	株式 113銘柄	12.81	—	—	13.74
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.60	—	—	1.72
オフショア・人民元	株式 467銘柄	4.84	—	—	5.19
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.93	—	—	1.00
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.82	—	—	0.88
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.11	—	—	0.12
サウジアラビア・リアル	株式 40銘柄	3.66	—	—	3.92
タイ・バーツ	株式 42銘柄	2.05	—	—	2.20
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.14	—	—	0.15
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.49	—	—	0.52
トルコ・リラ	株式 15銘柄	0.53	—	—	0.57
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.17	—	—	0.18
フィリピン・ペソ	株式 17銘柄	0.68	—	—	0.73
ブラジル・レアル	株式 46銘柄 投資信託受益証 券 4銘柄	4.56 —	— 0.17	— —	5.07
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.70	—	—	0.75
マレーシア・リンギット	株式 34銘柄	1.40	—	—	1.50
メキシコ・ペソ	株式 18銘柄 投資信託受益証 券 4銘柄 投資証券 1銘柄	1.76 — —	— 0.40 —	— — 0.05	2.37
ユーロ	株式 10銘柄	0.30	—	—	0.32
韓国・ウォン	株式 103銘柄	10.80	—	—	11.59
香港・ドル	株式 193銘柄	23.78	—	—	25.50
台湾・ドル	株式 88銘柄	12.96	—	—	13.90
南アフリカ・ランド	株式 36銘柄 投資証券 1銘柄	3.41 —	— —	— 0.04	3.70

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

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)

2023年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,127,451,838
コール・ローン	810,654,563
国債証券	122,130,500,602
派生商品評価勘定	39,891
未収利息	1,343,309,463
前払費用	425,433,351
流動資産合計	126,837,389,708
資産合計	126,837,389,708
負債の部	
流動負債	
未払金	1,640,780,240
未払解約金	250,000
流動負債合計	1,641,030,240
負債合計	1,641,030,240
純資産の部	
元本等	
元本	64,251,853,316
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	60,944,506,152
元本等合計	125,196,359,468
純資産合計	125,196,359,468
負債純資産合計	126,837,389,708

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年1月12日
	至 2023年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	67,295,763,529円
同期中追加設定元本額	153,491,081,451円
同期中一部解約元本額	156,534,991,664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)	107,018,143円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,373,212,341円
たわらノーロード バランス (堅実型)	173,454,767円
たわらノーロード バランス (標準型)	492,673,649円
たわらノーロード バランス (積極型)	207,461,235円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	911,954円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	5,330,034円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	61,222,562円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,316,537円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,078,135円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,598,674円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	250,043,672円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	387,327,305円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	706,275,379円
投資のソムリエ	20,358,266,706円
クルーズコントロール	53,995,128円
投資のソムリエ<DC年金>	1,471,362,128円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	305,966,961円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,609,338,476円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,987,721,193円
ワールドアセットバランス (基本コース)	441,610,114円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	288,731,174円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	61,411,967円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	30,826,286円

リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	11,066,622円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	236,029,689円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	787,878,174円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	231,359,150円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	79,069,288円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	32,668,247円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	20,411,537円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	4,283,630円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	20,904,918,138円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	538,630,768円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,097,273,451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）	381,680,377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）	10,734,230円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	18,762,551円
エマージング債券パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）	7,546,061円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	156,503,579円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	70,307,786円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,220,575,518円
計	64,251,853,316円
2. 受益権の総数	64,251,853,316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 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

<p>2. 時価の算定方法</p>	<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。 (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。</p>
<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>	<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	2023年1月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	56,433,719	
合計	56,433,719	

(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2023年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年1月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	1,100,000,000	—	—	1,100,039,891	39,891
合計	1,100,000,000	—	—	1,100,039,891	39,891

(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。

①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。

②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)

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額	1,9485円
(1万口当たり純資産額)	(19,485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

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT' L 0.75 09/02/23	3,000,000.000	2,916,390.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.625 06/02/28	7,000,000.000	6,146,700.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.7 03/02/31	6,000,000.000	4,954,056.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.875 09/15/31	7,000,000.000	5,796,301.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.125 09/30/24	9,000,000.000	8,624,340.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.5 04/16/25	12,000,000.000	11,491,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.5 09/30/29	10,000,000.000	8,995,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.7 09/02/70	3,000,000.000	1,869,936.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.125 04/16/30	10,000,000.000	9,265,980.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.125 09/30/49	10,000,000.000	7,400,580.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.875 04/16/50	9,000,000.000	7,595,730.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	8,566,945.290	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	7,000,000.000	5,982,250.820	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	13,000,000.000	11,490,150.490	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	8,000,000.000	7,536,800.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	15,000,000.000	10,773,561.750	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	2,100,000.000	1,801,606.210	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	4,800,000.000	5,001,800.060	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30		2,000,000.000	1,663,435.500
CHINA GOVT INTL BOND		4,000,000.000	3,629,179.440		

1. 25 10/26/26			
CHINA GOVT INTL BOND			
1. 95 12/03/24	1,000,000.000	956,860.000	
COLOMBIA 3. 0 01/30/30	7,000,000.000	5,395,316.430	
COLOMBIA 3. 125 04/15/31	11,000,000.000	8,233,436.750	
COLOMBIA 3. 25 04/22/32	9,000,000.000	6,563,286.180	
COLOMBIA 4. 125 05/15/51	5,000,000.000	3,024,657.550	
COLOMBIA 4. 5 01/28/26	5,000,000.000	4,729,851.750	
COLOMBIA 4. 5 03/15/29	9,000,000.000	7,820,819.730	
COLOMBIA 5. 2 05/15/49	11,000,000.000	7,715,400.000	
COLOMBIA 5. 625 02/26/44	2,000,000.000	1,484,544.060	
COLOMBIA 8. 0 04/20/33	6,000,000.000	6,046,597.020	
DOMINICAN REPUBLIC 5. 5 02/22/29	18,000,000.000	16,676,022.060	
DOMINICAN REPUBLIC 5. 875 01/30/60	19,000,000.000	14,148,725.250	
DOMINICAN REPUBLIC 6. 0 02/22/33	26,200,000.000	23,871,941.090	
HUNGARY 2. 125 09/22/31	13,000,000.000	9,621,066.000	
HUNGARY 3. 125 09/21/51	12,000,000.000	7,193,160.000	
HUNGARY 5. 25 06/16/29	8,000,000.000	7,618,982.320	
HUNGARY 5. 375 03/25/24	4,380,000.000	4,396,092.120	
HUNGARY 7. 625 03/29/41	2,400,000.000	2,628,496.800	
INDONESIA 1. 85 03/12/31	3,200,000.000	2,585,762.910	
INDONESIA 2. 85 02/14/30	2,000,000.000	1,796,899.260	
INDONESIA 3. 05 03/12/51	5,000,000.000	3,681,732.000	
INDONESIA 3. 4 09/18/29	2,200,000.000	2,014,779.640	
INDONESIA 3. 5 01/11/28	4,200,000.000	3,994,476.400	
INDONESIA 3. 85 10/15/30	6,400,000.000	6,016,023.160	
INDONESIA 4. 1 04/24/28	3,000,000.000	2,946,153.240	
INDONESIA 4. 125 01/15/25	3,200,000.000	3,180,924.700	
INDONESIA 4. 2 10/15/50	7,000,000.000	5,813,599.750	
INDONESIA 4. 35 01/08/27	4,600,000.000	4,558,879.260	
INDONESIA 4. 35 01/11/48	6,600,000.000	5,716,448.490	
INDONESIA 4. 75 01/08/26	2,000,000.000	2,013,189.080	
INDONESIA 5. 25 01/17/42	1,500,000.000	1,457,589.090	
INDONESIA 7. 75 01/17/38	2,500,000.000	3,031,311.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5. 625 01/17/28	12,000,000.000	11,863,200.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6. 0 08/01/29	11,000,000.000	11,083,600.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6. 25 01/25/31	11,000,000.000	11,120,120.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6. 75 01/17/48	8,000,000.000	7,587,200.000	
PANAMA 2. 252 09/29/32	14,000,000.000	10,491,286.540	
PANAMA 3. 16 01/23/30	8,000,000.000	6,932,800.000	
PANAMA 3. 87 07/23/60	13,000,000.000	8,444,301.320	
PANAMA 4. 5 01/19/63	5,000,000.000	3,566,668.550	
PANAMA 4. 5 04/01/56	11,000,000.000	8,135,324.010	

PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	7,072,456.000	
PANAMA 6.4 02/14/35	7,000,000.000	7,165,248.440	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,056,661.490	
PERU 2.392 01/23/26	2,000,000.000	1,845,498.760	
PERU 2.78 12/01/60	8,000,000.000	4,689,542.320	
PERU 2.783 01/23/31	16,000,000.000	13,321,492.640	
PERU 3.0 01/15/34	13,000,000.000	10,350,870.530	
PERU 3.55 03/10/51	9,000,000.000	6,459,016.140	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	3,600,000.000	2,865,780.030	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	3,800,000.000	3,292,696.420	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	7,000,000.000	4,699,038.330	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	9,000,000.000	8,365,749.660	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	7,000,000.000	5,090,678.110	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	2,000,000.000	1,625,621.200	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	7,200,000.000	6,876,268.700	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	6,200,000.000	5,192,803.110	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	5,952,947.540	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	8,000,000.000	6,326,433.360	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	8,200,000.000	7,595,029.740	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	5,000,000.000	3,170,366.650	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	11,000,000.000	8,024,023.590	
REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	7,600,000.000	7,129,560.000	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	6,000,000.000	4,350,880.440	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	6,200,000.000	5,338,316.680	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	4,000,000.000	2,876,576.280	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	9,000,000.000	7,727,598.540	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	13,000,000.000	12,975,151.930	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	13,000,000.000	12,577,200.480	
ROMANIA 3.0 02/14/31	4,000,000.000	3,210,252.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	10,000,000.000	6,706,780.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	3,709,440.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	6,600,000.000	6,081,867.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	8,000,000.000	6,453,344.000	

SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	9,000,000.000	8,613,900.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	10,200,000.000	9,303,664.800	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	4,000,000.000	2,846,920.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	6,400,000.000	5,010,400.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	13,000,000.000	12,857,000.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	18,000,000.000	17,790,390.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	12,000,000.000	11,870,616.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	6,000,000.000	5,308,590.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	9,000,000.000	8,449,290.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	7,000,000.000	6,834,079.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	8,000,000.000	8,424,800.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	12,000,000.000	10,982,928.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	2,400,000.000	2,349,000.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	17,000,000.000	13,048,146.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	4,000,000.000	3,821,760.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	12,000,000.000	10,833,600.000	
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	7,000,000.000	6,872,600.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,801,900.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	12,000,000.000	11,604,000.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	12,000,000.000	11,817,216.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	13,000,000.000	11,950,900.000	
STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	10,000,000.000	10,103,000.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	16,000,000.000	15,588,800.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	16,000,000.000	16,116,800.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	6,000,000.000	4,441,200.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05	5,000,000.000	4,941,960.000	

	07/07/32			
	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	9,000,000.000	7,387,073.910	
	UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,320,646.220	
	UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	9,000,000.000	7,382,757.330	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	5,200,000.000	4,955,288.670	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,574,317.930	
	UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	7,000,000.000	4,650,620.030	
	UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,578,979.540	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	2,400,000.000	2,360,848.200	
	UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	10,000,000.000	7,955,011.200	
	UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	7,000,000.000	5,363,981.840	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	5,000,000.000	3,943,115.400	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	9,000,000.000	8,704,971.270	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	2,000,000.000	1,614,414.320	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	8,000,000.000	7,611,330.240	
	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	7,000,000.000	6,561,707.250	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	6,000,000.000	5,052,425.820	
	アメリカ・ドル 小計	1,064,980,000.000 (141,003,352,000)	922,435,805.150 (122,130,500,602)	
国債証券 合計		141,003,352,000 (141,003,352,000)	122,130,500,602 (122,130,500,602)	
合計			122,130,500,602 (122,130,500,602)	

(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 136銘柄	97.55	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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,606,570,356
投資証券	192,505,859,750
未収配当金	1,446,669,125
前払金	172,213,530
差入委託証拠金	279,271,500
流動資産合計	198,010,584,261
資産合計	198,010,584,261
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	170,133,600
未払金	578,780,165
未払解約金	472,631,000
流動負債合計	1,221,544,765
負債合計	1,221,544,765
純資産の部	
元本等	
元本	85,187,544,308
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	111,601,495,188
元本等合計	196,789,039,496
純資産合計	196,789,039,496
負債純資産合計	198,010,584,261

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年1月12日
	至 2023年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	83,254,722,505円
同期中追加設定元本額	82,347,723,741円
同期中一部解約元本額	80,414,901,938円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド (安定型)	185,528円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	1,165,609円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	3,727,398円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	2,340,411円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	1,613,877円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	2,377,391円
たわらノーロード 国内リート	5,451,203,249円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,144,350,754円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,005,553,931円
たわらノーロード バランス (堅実型)	36,480,623円
たわらノーロード バランス (標準型)	689,991,569円
たわらノーロード バランス (積極型)	756,356,526円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	148,068,532円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	395,464,235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)	237,163,760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)	299,443,271円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,395,316円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	40,275,413円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,438,028円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,100,497円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,188,511円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	442,338,302円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,803円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	125,636,380円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	192,913,663円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	355,658,204円
投資のソムリエ	12,328,088,200円
投資のソムリエ<DC年金>	890,956,658円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,914,085円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	796,599,142円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,460,018,291円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	32,047,173円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	16,065,715円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,483,172円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	101,950,974円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	157,939,723円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	113,374,981円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	43,369,508円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	17,202,404円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	10,618,723円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,227,670円
Jリートインデックスファンド(DC)	63,535,821円
D I A M J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	704,411,388円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	760,808円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	88,046,327円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	708,067円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	9,767,562円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	551,421円
固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)	181,945,946円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	65,457,891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)	228,060,645円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	527,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	2,869,206円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	75,670,901円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	124,733,821円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	87,061,891円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	65,399,918円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	588,327円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	86,814,018円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き） 2021-12（適格機関投資家限定）	125,377,020円
DIAM J-REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	3,536,664,731円 329,779,722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）	51,846,803円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	94,350,960円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,014,158円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	6,500,426円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	9,276,636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）	1,156,979,171円
MHAM J-REITインデックスファンド（DC年金）	7,807,907,095円
MHAM J-REITインデックスファンド（毎月決算型）	37,034,342,906円
MHAM J-REITインデックスファンド（年1回決算型）	2,659,539,140円
MHAM J-REITインデックスファンド（ファンドラップ）	90,460,138円
計	85,187,544,308円
2. 受益権の総数	85,187,544,308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 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年1月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	△13,232,326,470	
合計	△13,232,326,470	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年6月7日から2023年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	4,474,630,530	—	4,304,754,000	△169,876,530
合計	4,474,630,530	—	4,304,754,000	△169,876,530

(注)時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2023年1月11日現在	
1口当たり純資産額	2.3101円
(1万口当たり純資産額)	(23,101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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファン ド投資法人	7,155	1,304,356,500	
	GLP投資法人	59,625	8,597,925,000	
	NTT都市開発リート投資法 人	17,758	2,400,881,600	
	Oneリート投資法人	3,222	781,979,400	
	SOSILA物流リート投資 法人	9,189	1,232,244,900	
	いちごオフィスリート投資法 人	15,137	1,288,158,700	
	いちごホテルリート投資法人	3,060	332,928,000	
	アクティビア・プロパティ ーズ投資法人	9,753	3,930,459,000	
	アドバンス・レジデンス投資 法人	18,471	6,233,962,500	
	アドバンス・ロジスティクス 投資法人	8,052	1,143,384,000	
	イオンリート投資法人	20,449	3,075,529,600	
	インヴィンシブル投資法人	81,310	4,211,858,000	
	エスコンジャパンリート投資 法人	3,755	447,596,000	
	オリックス不動産投資法人	36,808	6,621,759,200	
	グローバル・ワン不動産投資 法人	13,594	1,455,917,400	
	ケネディクス・オフィス投資 法人	10,749	3,364,437,000	
	ケネディクス・レジデンシャ ル・ネクスト投資法人	13,548	2,727,212,400	
	ケネディクス商業リート投資 法人	8,031	1,986,869,400	
	コンフォリア・レジデンシャ ル投資法人	8,594	2,506,869,800	
	サムティ・レジデンシャル投 資法人	4,802	552,230,000	
	サンケイリアルエステート投 資法人	5,918	520,192,200	
	ザイマックス・リート投資法 人	2,996	351,131,200	
	ジャパン・ホテル・リート投 資法人	59,574	4,652,729,400	
ジャパンエクセレント投資法	16,947	2,211,583,500		

人			
ジャパンリアルエステイト投資法人	18,474	10,696,446,000	
スターアジア不動産投資法人	23,066	1,245,564,000	
スターツプロシード投資法人	3,202	743,184,200	
タカラレーベン不動産投資法人	8,091	793,727,100	
トーセイ・リート投資法人	4,098	542,575,200	
ヒューリックリート投資法人	17,284	2,748,156,000	
フロンティア不動産投資法人	6,854	3,447,562,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	4,555	814,434,000	
マリモ地方創生リート投資法人	2,307	300,140,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	41,324	6,227,526,800	
ラサールロジポート投資法人	22,615	3,523,417,000	
阪急阪神リート投資法人	8,344	1,230,740,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,298	3,411,815,000	
三菱地所物流リート投資法人	6,347	2,621,311,000	
産業ファンド投資法人	27,607	4,074,793,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	4,334	568,187,400	
森トラスト総合リート投資法人	13,203	1,889,349,300	
森ヒルズリート投資法人	21,723	3,321,446,700	
星野リゾート・リート投資法人	3,231	2,313,396,000	
積水ハウス・リート投資法人	55,512	4,130,092,800	
大江戸温泉リート投資法人	2,982	185,778,600	
大和ハウスリート投資法人	27,846	7,969,525,200	
大和証券オフィス投資法人	3,827	2,391,875,000	
大和証券リビング投資法人	25,599	2,920,845,900	
投資法人みらい	22,443	1,002,079,950	
東海道リート投資法人	2,240	271,936,000	
東急リアル・エステート投資法人	12,386	2,541,607,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	6,379	3,801,884,000	
日本ビルファンド投資法人	21,551	12,478,029,000	
日本プライムリアルティ投資法人	12,634	4,567,191,000	
日本プロロジスリート投資法人	31,139	9,279,422,000	
日本リート投資法人	6,000	2,037,000,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,456	3,848,904,000	
日本都市ファンド投資法人	93,209	9,628,489,700	
福岡リート投資法人	9,554	1,594,562,600	

	平和不動産リート投資法人	12,625	1,900,062,500	
	野村不動産マスターファンド 投資法人	59,740	9,510,608,000	
投資証券	合計	1,100,576	192,505,859,750	
合計			192,505,859,750	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	337,210,094
コール・ローン	83,736,774
投資信託受益証券	6,836,619,284
投資証券	58,832,299,902
派生商品評価勘定	35,452
未収配当金	241,647,845
流動資産合計	66,331,549,351
資産合計	66,331,549,351
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,775
未払金	799,958,085
未払解約金	15,170,000
流動負債合計	815,129,860
負債合計	815,129,860
純資産の部	
元本等	
元本	41,342,647,392
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	24,173,772,099
元本等合計	65,516,419,491
純資産合計	65,516,419,491
負債純資産合計	66,331,549,351

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年1月12日 至 2023年1月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4. 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	2023年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	46,542,419,917円
同期中追加設定元本額	82,189,071,015円
同期中一部解約元本額	87,388,843,540円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国RE 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)	74,856,900円
D I A M先進国RE 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)	24,449,599円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,099,653円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	19,487,977円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	62,551,453円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	39,100,979円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	27,070,555円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	39,566,588円
たわらノーロード 先進国リート	14,763,810,090円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,812,024,801円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	320,652,518円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,961,774,991円
たわらノーロード バランス (堅実型)	27,055,041円

たわらノーロード バランス (標準型)	512,301,106円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,035,475,457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)	222,633,767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)	237,642,056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)	405,677,178円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	598,976円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	30,224,478円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,006,832円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	22,817,302円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,558,733,524円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,049,798円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	511,767,802円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	41,237,895円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	185,757,051円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	288,624,187円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	529,206,361円
投資のソムリエ	8,434,526,260円
投資のソムリエ<DC年金>	609,837,865円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	231,792,328円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	537,024,354円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,330,232,379円
ワールドアセットバランス (基本コース)	347,351,219円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	234,283,572円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	25,934,555円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	13,019,485円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	3,689,293円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	84,888,057円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	239,536,644円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	172,960,853円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	37,554,612円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	13,793,656円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	8,621,171円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	1,803,168円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	255,573,651円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	293,784,187円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	983,915円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	656,048円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	459,027円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	583,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 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)	223,271,265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)	3,615,759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（FOF s用）（適格機関投資家専用）	4,443,460円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	6,255,668円
D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	77,198,966円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	193,831,515円
D I A M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）	1,171,136,561円
計	41,342,647,392円
2. 受益権の総数	41,342,647,392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 2022年1月12日 至 2023年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	2023年1月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	
投資信託受益証券	△101,876,032	
投資証券	△1,964,153,262	
合計	△2,066,029,294	

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間 (2022年6月23日から2023年1月11日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等 (円)	うち		評価損益 (円)
		1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引 為替予約取引				
買建	668,474,342	—	668,508,019	33,677
アメリカ・ドル	503,033,360	—	503,053,120	19,760
イギリス・ポンド	35,409,990	—	35,413,928	3,938
オーストラリア・ドル	47,477,040	—	47,482,448	5,408
カナダ・ドル	13,800,640	—	13,800,864	224
シンガポール・ドル	25,844,000	—	25,848,108	4,108
ニュージーランド・ドル	4,217,700	—	4,217,530	△170
ユーロ	27,023,757	—	27,025,771	2,014
韓国・ウォン	3,193,200	—	3,192,000	△1,200
香港・ドル	8,474,655	—	8,474,250	△405
合計	668,474,342	—	668,508,019	33,677

(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。

①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。

②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)

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額	1,5847円
(1万口当たり純資産額)	(15,847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

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益 証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	144,600.000	81,699.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	309,900.000	148,752.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	645,800.000	177,595.000		
		PRIME US REIT	238,000.000	90,440.000		
		アメリカ・ドル	小計	1,411,000.000	498,486.000 (65,999,546)	
		オーストラリ ア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	162,893.000	423,521.800	
	ARENA REIT		137,166.000	513,000.840		
	BWP TRUST		181,749.000	707,003.610		
	CENTURIA CAPITAL GROUP		277,234.000	487,931.840		
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT		211,587.000	664,383.180		
	CENTURIA OFFICE REIT		170,806.000	259,625.120		
	CHARTER HALL GROUP		183,512.000	2,237,011.280		
	CHARTER HALL LONG WALE REIT		254,913.000	1,142,010.240		
	CHARTER HALL RETAIL REIT		194,587.000	737,484.730		
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT		122,555.000	400,754.850		
	CROMWELL PROPERTY GROUP		516,778.000	346,241.260		
	DEXUS		416,200.000	3,258,846.000		
	DEXUS INDUSTRIA REIT		78,918.000	227,283.840		
	GDI PROPERTY GROUP		210,436.000	157,827.000		
GOODMAN GROUP	662,814.000		11,824,601.760			
GPT GROUP	741,360.000	3,180,434.400				
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	107,003.000	328,499.210				
HEALTHCO REIT	92,113.000	162,579.440				
HMC CAPITAL LTD	75,942.000	331,107.120				
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	584,130.000	741,845.100				
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,699.000	261,631.450				
INGENIA COMMUNITIES	145,143.000	654,594.930				

	GROUP			
	MIRVAC GROUP	1,526,781.000	3,313,114.770	
	NATIONAL STORAGE REIT	423,078.000	964,617.840	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	105,257.250	
	REGION RE LTD	442,491.000	1,146,051.690	
	RURAL FUNDS GROUP	141,590.000	335,568.300	
	SCENTRE GROUP	2,003,467.000	5,769,984.960	
	STOCKLAND	923,539.000	3,380,152.740	
	VICINITY CENTRES	1,497,919.000	2,965,879.620	
	WAYPOINT REIT LTD	281,772.000	766,419.840	
	オーストラリア・ドル 小計	12,982,518.000	47,795,266.010 (4,365,141,644)	
シンガポール・ ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	201,395.000	249,729.800	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	812,816.000	845,328.640	
	CAPITALAND CHINA TRUST	454,580.000	531,858.600	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,945,509.000	3,891,018.000	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,299,160.000	3,546,706.800	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	307,200.000	384,000.000	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	224,800.000	146,120.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	50,018.000	
	ESR LOGOS REIT	2,103,640.000	788,865.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	393,900.000	248,157.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	389,500.000	101,270.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	423,000.000	867,150.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,127,964.000	1,297,158.600	
	KEPPEL DC REIT	511,500.000	941,160.000	
	KEPPEL REIT	780,800.000	698,816.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	744,500.000	498,815.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	777,320.000	1,748,970.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,250,220.000	2,037,858.600	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	896,200.000	1,541,464.000	
	QUE COMMERCIAL REIT	910,555.000	314,141.470	
	PARAGON REIT	394,200.000	356,751.000	
	PARKWAY LIFE REIT	153,300.000	574,875.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	207,400.000	160,735.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	553,000.000	301,385.000	

		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	874,890.000	1,172,352.600	
	シンガポール・ドル	小計	17,849,749.000	23,294,704.110 (2,316,425,377)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	133,740.000	197,935.200	
	ユーロ	小計	133,740.000	197,935.200 (28,156,282)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	573,000.000	3,592,710.000	
	香港・ドル	小計	573,000.000	3,592,710.000 (60,896,435)	
投資信託受益証券 合計			32,950,007	6,836,619,284 (6,836,619,284)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,926.000	502,245.480	
		AGREE REALTY CORP	34,792.000	2,482,757.120	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	28,607.000	540,958.370	
		ALEXANDER'S INC.	801.000	179,215.740	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	58,447.000	8,630,284.020	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,698.000	90,530.460	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	20,483.000	545,462.290	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	120,371.000	3,724,278.740	
		AMERICOLD REALTY TRUST	105,726.000	3,113,630.700	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	58,046.000	2,025,805.400	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	60,135.000	442,593.600	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	82,638.000	1,323,034.380	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	25,069.000	290,299.020	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	58,894.680	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	54,756.000	8,924,680.440	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,188.000	25,827.120	
		BOSTON PROPERTIES INC	55,944.000	3,770,066.160	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,173.000	91,383.690	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	65,995.000	403,889.400	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	117,776.000	2,549,850.400	
		BROADSTONE NET LEASE INC	67,356.000	1,167,953.040	
		BRT APARTMENTS CORP	4,220.000	82,247.800	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	41,747.000	4,733,692.330	
		CARETRUST REIT INC	38,168.000	717,176.720	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	9,033.000	209,475.270	
		CENTERSPACE	5,508.000	327,285.360	

CHATHAM LODGING TRUST	19,111.000	232,580.870	
CITY OFFICE REIT INC	15,657.000	128,230.830	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	35,652.860	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,646.000	325,867.740	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	43,815.000	1,139,628.150	
COUSINS PROPERTIES INC	58,757.000	1,430,732.950	
CTO REALTY GROUTH INC	6,628.000	122,750.560	
CUBESMART	88,085.000	3,529,565.950	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	82,077.000	666,465.240	
DIGITAL REALTY TRUST INC	112,502.000	11,511,204.640	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80,900.000	67,632.400	
DOUGLAS EMMETT INC	68,568.000	1,041,547.920	
EAST GROUP	17,114.000	2,574,459.020	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	34,578.000	519,015.780	
ELME COMMUNITIES	34,355.000	620,107.750	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	50,759.000	351,252.280	
EPR PROPERTIES	29,194.000	1,092,731.420	
EQUINIX INC	36,187.000	25,155,393.050	
EQUITY COMMONWEALTH	42,581.000	1,076,873.490	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	68,568.000	4,490,518.320	
EQUITY RESIDENTIAL	133,152.000	7,822,680.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	55,312.000	1,277,707.200	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,368.000	5,430,274.080	
EXTRA SPACE STORAGE INC	52,428.000	7,679,653.440	
FARMLAND PARTNERS INC	17,744.000	222,864.640	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	28,688.000	2,921,299.040	
FIRST INDUSTRIAL RT	51,900.000	2,525,454.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	32,805.000	895,904.550	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,176.000	92,892.800	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	100,896.000	5,159,821.440	
GETTY REALTY CORP	16,720.000	575,836.800	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14,534.000	282,540.960	
GLADSTONE LAND CORP	11,727.000	221,640.300	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	22,924.000	222,821.280	
GLOBAL NET LEASE INC	41,493.000	558,910.710	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	149,347.000	3,063,106.970	

HEALTHPEAK PROPERTIES INC	210,573.000	5,506,483.950	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,525.000	111,310.750	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	40,908.000	1,157,696.400	
HOST HOTELS & RESORTS INC	280,240.000	4,609,948.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	50,905.000	490,724.200	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	86,856.000	1,450,495.200	
INDUS REALTY TRUST INC	2,126.000	134,341.940	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	107,255.190	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,909.000	1,120,136.120	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	26,466.000	618,510.420	
INVITATION HOMES INC	227,441.000	6,780,016.210	
IRON MOUNTAIN INC	113,873.000	5,711,869.680	
ISTAR INC	31,134.000	252,185.400	
JBG SMITH PROPERTIES	38,727.000	747,043.830	
KILROY REALTY CORP	40,791.000	1,541,899.800	
KIMCO REALTY	242,318.000	4,938,440.840	
KITE REALTY GROUP TRUST	84,873.000	1,698,308.730	
LIFE STORAGE INC	33,347.000	3,268,339.470	
LTC PROPERTIES INC	15,922.000	569,370.720	
LXP INDUSTRIAL TRUST	107,271.000	1,142,436.150	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	234,736.000	2,931,852.640	
MID AMERICA	45,215.000	6,995,664.800	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,958.000	886,564.240	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	70,126.000	3,223,692.220	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	32,859.000	1,184,895.540	
NETSTREIT CORP	20,589.000	383,778.960	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	11,872.000	132,610.240	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,811.000	361,955.880	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,765.000	279,443.450	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	91,971.000	2,478,618.450	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,609.000	129,231.360	
ORION OFFICE REIT INC	21,073.000	178,277.580	
PARAMOUNT GROUP INC	65,642.000	370,877.300	
PARK HOTELS & RESORTS INC	87,740.000	1,057,267.000	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	51,524.000	703,302.600	

PHILLIPS EDISON & CO INC	45,439.000	1,441,779.470	
PHYSICIANS REALTY TRUST	88,668.000	1,330,906.680	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,250.000	438,007.500	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,621.000	306,796.440	
POSTAL REALTY TRUST INC	7,309.000	107,661.570	
PROLOGIS INC	360,896.000	41,881,980.800	
PUBLIC STORAGE	61,828.000	17,384,797.040	
REALTY INCOME CORP	245,318.000	15,734,696.520	
REGENCY CENTERS CORP	60,395.000	3,746,301.850	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	48,965.000	716,357.950	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	71,941.000	4,019,343.670	
RLJ LODGING TRUST	63,507.000	686,510.670	
RPT REALTY	31,140.000	293,027.400	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,377.000	1,754,624.160	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	89,832.000	1,137,273.120	
SAFEHOLD INC	8,894.000	270,021.840	
SAUL CENTERS INC	4,804.000	189,854.080	
SERVICE PROPERTIES TRUST	62,996.000	489,478.920	
SIMON PROPERTY GROUP INC	127,893.000	14,944,297.050	
SITE CENTERS CORP	72,024.000	908,942.880	
SL GREEN	25,224.000	894,443.040	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	54,044.000	2,180,675.400	
STAG INDUSTRIAL INC	69,838.000	2,316,526.460	
STORE CAPITAL CORP	104,247.000	3,347,371.170	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,921.000	288,015.400	
SUN COMMUNITIES INC	48,509.000	6,973,168.750	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	82,660.000	790,229.600	
TANGER FACTORY OUTLET	41,032.000	726,676.720	
TERRENO REALTY CORP	25,970.000	1,511,973.400	
THE MACERICH COMPANY	83,863.000	959,392.720	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	51,710.000	326,290.100	
UDR INC	119,929.000	4,628,060.110	
UMH PROPERTIES INC	20,807.000	340,610.590	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,699.000	231,660.700	
URBAN EDGE PROPERTIES	46,764.000	662,645.880	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,191.000	199,199.800	
VENTAS INC	156,492.000	7,478,752.680	
VERIS RESIDENTIAL INC	31,286.000	515,906.140	

	VICI PROPERTIES INC	376,820.000	12,201,431.600	
	VORNADO REALTY TRUST	62,559.000	1,365,037.380	
	WELLTOWER INC	184,867.000	12,753,974.330	
	WHITESTONE REIT	16,382.000	160,543.600	
	WP CAREY INC	81,464.000	6,546,447.040	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	44,849.000	574,067.200	
アメリカ・ドル	小計	8,608,707.000	381,029,741.840 (50,448,337,820)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	162,134.000	103,441.490	
	AEW UK REIT PLC	58,660.000	59,715.880	
	ASSURA PLC	1,162,717.000	644,145.210	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	307,797.000	265,628.810	
	BIG YELLOW GROUP PLC	68,187.000	780,741.150	
	BRITISH LAND CO PLC	369,097.000	1,514,035.890	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	336,778.000	355,974.340	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	232,446.000	141,559.610	
	CLS HOLDINGS PLC	66,862.000	100,560.440	
	CUSTODIAN REIT PLC	166,617.000	149,622.060	
	DERWENT LONDON PLC	43,623.000	1,053,931.680	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	74,836.000	46,997.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	221,510.000	195,371.820	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	99,629.000	523,052.250	
	HAMMERSON PLC	1,603,383.000	402,449.130	
	HOME REIT PLC	286,621.000	108,915.980	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	160,660.000	165,801.120	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	295,183.000	1,967,689.870	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	385,555.000	685,516.790	
	LXI REIT PLC	669,863.000	771,682.170	
	NEWRIVER REIT PLC	124,025.000	103,064.770	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	213,675.000	166,666.500	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	523,160.000	593,263.440	
	PRS REIT PLC/THE	206,206.000	171,769.590	
	REGIONAL REIT LTD	168,230.000	101,779.150	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	82,584.000	777,528.360	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	206,528.000	90,872.320	

	SEGRO PLC	473,952.000	3,748,960.320	
	SHAFTESBURY PLC	113,640.000	405,694.800	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	487,963.000	484,059.290	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	153,569.000	91,834.260	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	726,105.000	1,042,686.780	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	316,742.000	178,325.740	
	UNITE GROUP PLC	157,519.000	1,459,413.530	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	191,976.000	253,408.320	
	WAREHOUSE REIT PLC	156,027.000	163,204.240	
	WORKSPACE GROUP PLC	56,124.000	261,537.840	
	イギリス・ポンド 小計	11,361,223.000	20,130,901.940 (3,240,873,903)	
イスラエル・シケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,208.000	409,658.210	
	REIT 1 LTD	76,692.000	1,349,779.200	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	84,874.000	713,281.090	
	イスラエル・シケル 小計	398,774.000	2,472,718.500 (94,500,625)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	24,754.000	693,112.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,627.000	221,148.720	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,337.000	102,461.730	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,095.000	452,658.150	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,285.000	127,560.350	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	58,607.400	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	32,471.000	1,464,766.810	
	CHOICE PROPERTIES REIT	62,701.000	943,650.050	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,845.000	303,592.950	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,186.000	307,359.720	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	47,425.000	584,276.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,013.000	146,641.510	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,876.000	56,488.160	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,257.000	716,221.520	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,246.000	871,057.980	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	51,480.000	634,748.400	

	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	19,639.890	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	28,263.000	384,942.060	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,270.000	390,703.300	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,096.000	119,416.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,458.000	110,754.700	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,304.000	121,194.400	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,773.000	459,310.860	
	PRIMARIS REIT	18,329.000	272,552.230	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,243.000	63,404.170	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	57,982.000	1,260,528.680	
	SLATE GROCERY REIT	11,204.000	174,446.280	
	SLATE OFFICE REIT	17,818.000	78,933.740	
	SMARTCENTRES REIT	27,873.000	764,835.120	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	35,650.000	809,255.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	14,758.000	88,990.740	
	カナダ・ドル 小計	724,685.000	12,803,258.620 (1,262,273,267)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	329,282.000	386,906.350	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	400,978.000	822,004.900	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	625,672.000	581,874.960	
	PRECINCT PROPERTIES	504,991.000	641,338.570	
	STRIDE STAPLED GROUP	200,290.000	286,414.700	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	190,316.000	432,017.320	
	ニュージーランド・ドル 小計	2,251,529.000	3,150,556.800 (265,812,477)	
ユーロ	AEDIFICA	15,481.000	1,219,902.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,939.000	31,315.050	
	ALTAREA	1,720.000	220,160.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	10,525.000	168,400.000	
	CARMILA SA	21,980.000	302,884.400	
	COFINIMMO SA	11,672.000	1,031,804.800	
	COVIVIO	18,058.000	1,055,490.100	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	16,907.000	397,990.780	
	GECINA SA	21,362.000	2,149,017.200	
	HAMBORNER REIT AG	25,669.000	178,142.860	
	ICADE	12,223.000	531,700.500	

	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	19,492.000	63,641.380	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	117,417.000	736,204.590	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,928.000	198,560.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	155,162.000	173,160.790	
	KLEPIERRE	76,589.000	1,684,958.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22,349.000	95,877.210	
	MERCIALYS	30,882.000	312,525.840	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	129,615.000	1,157,461.950	
	MONTEA SCA	4,768.000	325,654.400	
	NSI NV	6,797.000	161,088.900	
	RETAIL ESTATES	4,371.000	271,876.200	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	41,974.000	2,219,585.120	
	VASTNED RETAIL	6,847.000	142,417.600	
	WAREHOUSES DE PAUW	61,002.000	1,709,276.040	
	WERELDHAVE NV	16,132.000	219,395.200	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,862.000	254,339.400	
	ユーロ 小計	871,723.000	17,012,831.110 (2,420,075,225)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,294.000	58,902,810.000	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	11,135.000	58,904,150.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	60,102.000	242,812,080.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,032.000	54,718,720.000	
	JR REIT XXVII	55,330.000	243,175,350.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,110.000	76,194,000.000	
	LOTTE REIT CO LTD	46,445.000	187,405,575.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	39,605.000	161,984,450.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	20,887.000	74,671,025.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,249.000	161,580,550.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,851.000	39,009,960.000	
SK REITS CO LTD	29,445.000	162,536,400.000		
	韓国・ウォン 小計	337,485.000	1,521,895,070.000 (161,929,635)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	696,070.000	2,213,502.600	
	LINK REIT	815,620.000	48,896,419.000	
	PROSPERITY REIT	475,000.000	978,500.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	385,000.000	1,282,050.000	

	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	892,000.000	1,998,080.000	
	香港・ドル 小計	3,263,690.000	55,368,551.600 (938,496,950)	
投資証券	合計	27,817,816	58,832,299,902 (58,832,299,902)	
合計			65,668,919,186 (65,668,919,186)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 5銘柄 投資証券 141銘柄	0.10 —	— 77.00	76.92
イギリス・ポンド	投資証券 38銘柄	—	4.95	4.94
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	—	0.14	0.14
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	6.66	—	6.65
カナダ・ドル	投資証券 31銘柄	—	1.93	1.92
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	3.54	—	3.53
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	—	0.41	0.40
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 27銘柄	0.04 —	— 3.69	3.73
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	—	0.25	0.25
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 5銘柄	0.09 —	— 1.43	1.52

(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。

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期中間計算期間（2023年1月12日から2023年7月11日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）の2023年1月12日から2023年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）の2023年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月12日から2023年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

【中間財務諸表】

【DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 2023年1月11日現在	第12期中間計算期間末 2023年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	428,672,714	482,105,756
親投資信託受益証券	9,553,136,234	10,846,192,669
未収入金	—	2,832,000
流動資産合計	9,981,808,948	11,331,130,425
資産合計	9,981,808,948	11,331,130,425
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,760,296	9,088,482
未払受託者報酬	1,948,982	2,035,267
未払委託者報酬	15,592,242	16,282,426
その他未払費用	198,154	206,926
流動負債合計	28,499,674	27,613,101
負債合計	28,499,674	27,613,101
純資産の部		
元本等		
元本	6,302,143,676	6,741,162,944
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,651,165,598	4,562,354,380
（分配準備積立金）	1,133,640,334	1,093,579,202
元本等合計	9,953,309,274	11,303,517,324
純資産合計	9,953,309,274	11,303,517,324
負債純資産合計	9,981,808,948	11,331,130,425

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期中間計算期間 自 2022年1月12日 至 2022年7月11日	第12期中間計算期間 自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
営業収益		
受取利息	1,434	1,998
有価証券売買等損益	△230,382,864	661,521,435
営業収益合計	△230,381,430	661,523,433
営業費用		
支払利息	41,143	88,094
受託者報酬	1,866,255	2,035,267
委託者報酬	14,930,353	16,282,426
その他費用	189,745	206,926
営業費用合計	17,027,496	18,612,713
営業利益又は営業損失(△)	△247,408,926	642,910,720
経常利益又は経常損失(△)	△247,408,926	642,910,720
中間純利益又は中間純損失(△)	△247,408,926	642,910,720
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	△6,691,122	12,466,016
期首剰余金又は期首欠損金(△)	3,897,151,994	3,651,165,598
剰余金増加額又は欠損金減少額	227,318,224	417,639,424
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	227,318,224	417,639,424
剰余金減少額又は欠損金増加額	132,797,777	136,895,346
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	132,797,777	136,895,346
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	3,750,954,637	4,562,354,380

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第12期中間計算期間	
	自	至
	2023年1月12日	2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期中間計算期間末
	2023年1月11日現在	2023年7月11日現在
1. 期首元本額	5,955,798,022円	6,302,143,676円
期中追加設定元本額	772,352,210円	674,696,263円
期中一部解約元本額	426,006,556円	235,676,995円
2. 受益権の総数	6,302,143,676口	6,741,162,944口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期	第12期中間計算期間末
	2023年1月11日現在	2023年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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があります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 2023年1月11日現在	第12期中間計算期間末 2023年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,5794円 (15,794円)	1,6768円 (16,768円)

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）の2023年1月12日から2023年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）の2023年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月12日から2023年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

【DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 2023年1月11日現在	第12期中間計算期間末 2023年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	249,779,747	289,968,970
親投資信託受益証券	7,474,001,701	8,476,967,898
流動資産合計	7,723,781,448	8,766,936,868
資産合計	7,723,781,448	8,766,936,868
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,693,375	7,093,186
未払受託者報酬	1,499,861	1,564,723
未払委託者報酬	13,284,898	13,859,193
その他未払費用	152,467	159,073
流動負債合計	19,630,601	22,676,175
負債合計	19,630,601	22,676,175
純資産の部		
元本等		
元本	3,788,001,637	3,966,010,631
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,916,149,210	4,778,250,062
（分配準備積立金）	1,085,210,372	1,038,501,828
元本等合計	7,704,150,847	8,744,260,693
純資産合計	7,704,150,847	8,744,260,693
負債純資産合計	7,723,781,448	8,766,936,868

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期中間計算期間 自 2022年1月12日 至 2022年7月11日	第12期中間計算期間 自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
営業収益		
受取利息	814	1,189
有価証券売買等損益	△163,228,400	681,151,197
営業収益合計	△163,227,586	681,152,386
営業費用		
支払利息	21,824	51,936
受託者報酬	1,270,012	1,564,723
委託者報酬	11,249,001	13,859,193
その他費用	129,086	159,073
営業費用合計	12,669,923	15,634,925
営業利益又は営業損失(△)	△175,897,509	665,517,461
経常利益又は経常損失(△)	△175,897,509	665,517,461
中間純利益又は中間純損失(△)	△175,897,509	665,517,461
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	△9,051,942	16,759,569
期首剰余金又は期首欠損金(△)	3,509,094,717	3,916,149,210
剰余金増加額又は欠損金減少額	747,215,439	390,553,211
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	747,215,439	390,553,211
剰余金減少額又は欠損金増加額	189,637,293	177,210,251
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	189,637,293	177,210,251
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	3,899,827,296	4,778,250,062

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第12期中間計算期間	
	自 2023年1月12日	至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期中間計算期間末
	2023年1月11日現在	2023年7月11日現在
1. 期首元本額	3,109,511,300円	3,788,001,637円
期中追加設定元本額	1,012,283,711円	349,050,107円
期中一部解約元本額	333,793,374円	171,041,113円
2. 受益権の総数	3,788,001,637口	3,966,010,631口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期	第12期中間計算期間末
	2023年1月11日現在	2023年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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があります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 2023年1月11日現在	第12期中間計算期間末 2023年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,0338円 (20,338円)	2,2048円 (22,048円)

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）の2023年1月12日から2023年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）の2023年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月12日から2023年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

【DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 2023年1月11日現在	第12期中間計算期間末 2023年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	216,508,547	249,445,026
親投資信託受益証券	9,189,044,065	10,583,432,674
未収入金	—	6,006,000
流動資産合計	9,405,552,612	10,838,883,700
資産合計	9,405,552,612	10,838,883,700
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,269,367	15,565,828
未払受託者報酬	1,820,941	1,909,119
未払委託者報酬	17,689,515	18,546,147
その他未払費用	185,125	194,101
流動負債合計	31,964,948	36,215,195
負債合計	31,964,948	36,215,195
純資産の部		
元本等		
元本	3,662,294,004	3,812,021,250
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	5,711,293,660	6,990,647,255
（分配準備積立金）	1,601,236,439	1,489,825,561
元本等合計	9,373,587,664	10,802,668,505
純資産合計	9,373,587,664	10,802,668,505
負債純資産合計	9,405,552,612	10,838,883,700

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期中間計算期間 自 2022年1月12日 至 2022年7月11日	第12期中間計算期間 自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
営業収益		
受取利息	722	1,029
有価証券売買等損益	△240,055,197	1,048,648,609
営業収益合計	△240,054,475	1,048,649,638
営業費用		
支払利息	20,935	44,795
受託者報酬	1,691,933	1,909,119
委託者報酬	16,436,321	18,546,147
その他費用	172,000	194,101
営業費用合計	18,321,189	20,694,162
営業利益又は営業損失(△)	△258,375,664	1,027,955,476
経常利益又は経常損失(△)	△258,375,664	1,027,955,476
中間純利益又は中間純損失(△)	△258,375,664	1,027,955,476
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	△32,515,019	35,037,175
期首剰余金又は期首欠損金(△)	5,594,870,163	5,711,293,660
剰余金増加額又は欠損金減少額	810,777,536	706,971,371
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	810,777,536	706,971,371
剰余金減少額又は欠損金増加額	561,200,819	420,536,077
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	561,200,819	420,536,077
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	5,618,586,235	6,990,647,255

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第12期中間計算期間
	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期中間計算期間末
	2023年1月11日現在	2023年7月11日現在
1. 期首元本額	3,332,805,582円	3,662,294,004円
期中追加設定元本額	935,702,228円	418,811,014円
期中一部解約元本額	606,213,806円	269,083,768円
2. 受益権の総数	3,662,294,004口	3,812,021,250口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期	第12期中間計算期間末
	2023年1月11日現在	2023年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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があります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 2023年1月11日現在	第12期中間計算期間末 2023年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,5595円 (25,595円)	2,8338円 (28,338円)

(参考)

「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)」、「DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・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、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,595,778,730
株式	418,269,121,420
派生商品評価勘定	7,485,910
未収入金	8,826,880
未収配当金	601,512,339
前払金	144,650,000
差入委託証拠金	375,300,000
流動資産合計	428,002,675,279
資産合計	428,002,675,279
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	160,117,960
未払解約金	212,082,000
流動負債合計	372,199,960
負債合計	372,199,960
純資産の部	
元本等	
元本	110,812,327,700
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	316,818,147,619
元本等合計	427,630,475,319
純資産合計	427,630,475,319
負債純資産合計	428,002,675,279

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日
	至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	113,153,180,874円
同期中追加設定元本額	29,505,530,023円
同期中一部解約元本額	31,846,383,197円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,567,674,994円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	2,783,283,113円
One DC 国内株式インデックスファンド	27,274,316,290円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,743,482,619円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,417,257円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	8,999,824円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	21,435,255円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	19,817,330円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	23,848,606円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	15,127,704円
たわらノーロード TOPIX	1,868,263,340円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,536,831,620円
たわらノーロード バランス（堅実型）	49,875,831円
たわらノーロード バランス（標準型）	349,509,443円
たわらノーロード バランス（積極型）	565,347,579円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	3,068,350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）	164,390,899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）	429,392,594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）	343,743,787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）	485,558,316円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	376,756円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,598,485円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	32,741,247円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	3,776,284円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,578,520円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,320,196,114円
O n eグローバルバランス	22,034,929円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	998,260,265円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,502,278,818円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,899,282,822円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	314,801,257円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,032,386,759円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,106,134,254円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,264,986円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	303,367,667円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	340,413,028円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	559,938,611円
投資のソムリエ	4,965,577,838円
クルーズコントロール	536,916,590円
投資のソムリエ<DC年金>	404,957,646円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	346,957,395円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	942,518,924円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	341,595,789円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,302,203,635円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	67,712,673円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	33,590,538円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,464,186円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	109,864,123円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	487,735,046円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	894,501,920円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	249,168,511円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	73,448,347円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	37,099,480円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	22,864,207円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	416,483,587円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,278,337円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,798,536円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	42,386,412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)	52,937,095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)	54,264,978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)	38,201,798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)	32,987,283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)	52,024,685円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	132,692,574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)	211,035,102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)	47,065,644円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	216,070,113円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	528,847,953円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	135,825,853円
AMOn eマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	27,267,111円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	26,546,249円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	143,932,219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）	88,094,308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）	1,929,774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）	40,211,940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）	82,383,139円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,836,743円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	12,710,824円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,753,268円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	85,624円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,640,628円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	19,601,758円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	352,786,196円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	463,833,725円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,379,791,757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）	12,295,790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）	18,194,450円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	183,671,454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）	34,317,799円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	59,127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）	230,233,903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）	14,634,330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）	45,414,027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）	105,243,918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）	151,146,760円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	19,934,144円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	13,359,047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）	4,159,759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）	36,747,909円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,408,586円
コア資産形成ファンド	15,941,080円
MHAMトピックスファンド	777,114,462円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	45,372,729円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,128,230,002円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,453,012,308円

計	110,812,327,700円
2. 受益権の総数	110,812,327,700口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年7月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	8,764,955,000	—	8,612,450,000	△152,505,000
合計	8,764,955,000	—	8,612,450,000	△152,505,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額	3.8591円
(1万口当たり純資産額)	(38,591円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,418,172,508
国債証券	481,079,691,350
地方債証券	31,532,452,704
特殊債券	29,985,992,976
社債券	25,480,713,390
未収利息	705,451,049
前払費用	69,392,675
流動資産合計	570,271,866,652
資産合計	570,271,866,652
負債の部	
流動負債	
未払解約金	84,873,000
流動負債合計	84,873,000
負債合計	84,873,000
純資産の部	
元本等	
元本	451,050,455,847
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	119,136,537,805
元本等合計	570,186,993,652
純資産合計	570,186,993,652
負債純資産合計	570,271,866,652

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあつては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	441,014,150,576円
同期中追加設定元本額	351,952,707,867円
同期中一部解約元本額	341,916,402,596円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	25,563,401,411円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	56,293,657円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	93,184,476円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	52,366,055円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	777,588,422円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	246,944,828円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	37,099,711円
たわらノーロード 国内債券	18,539,181,128円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	4,562,585,822円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,385,059,097円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,554,111,493円
たわらノーロード バランス（積極型）	333,602,761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）	164,197,705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）	2,075,333,737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）	2,169,025,788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）	597,010,215円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	28,495,910円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	21,129,197円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	175,302,838円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,966,712円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,872,429,660円
O n eグローバルバランス	65,345,966円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	10,158,441,948円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	14,543,555,204円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	6,346,653,871円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,479,578,880円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,540,022,707円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	462,055,564円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	74,223,820円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,843,395,929円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,036,864円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	4,956,063,292円

D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,140,169,962円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	427,959,915円
投資のソムリエ	100,007,028,908円
クルーズコントロール	1,473,088,109円
投資のソムリエ<DC年金>	8,156,425,983円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,922,360,410円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,610,527,393円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,509,499,603円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	36,245,246,105円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	325,435,388円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	161,050,796円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	68,610,618円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,403,102,512円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,889,614,154円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	13,760,509,960円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,733,653,831円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	391,387,265円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	178,007,365円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	109,773,915円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,593,674,865円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	25,283,549円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	136,995,068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)	1,149,833,834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)	1,177,214,557円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,527,601,112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)	714,139,873円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,129,000,572円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	2,919,890,148円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,944,005,150円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,020,368,340円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	1,991,923,654円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,205,345,851円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,294,012,068円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,734,251,606円
A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	583,116,810円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	270,703,526円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	4,665,654,869円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII(適格機関投資家限定)	4,676,992,168円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV(適格機関投資家限定)	4,633,549,045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）	1,913,787,731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）	39,571,285円
AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	911,099,189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）	149,937,203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）	102,304,568円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	20,538,088円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	59,289,077円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	29,114,755円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	352,199円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	7,662,596円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	91,500,530円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2,925,850,535円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,163,394,059円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,289,697,515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）	56,761,364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）	140,772,178円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	1,703,211,929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）	105,654,328円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	546,725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）	1,898,420,501円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	45,363,393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）	282,510,892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）	435,928,036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）	782,523,327円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	202,244,313円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	96,924,285円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	748,262,131円
動的パッケージファンド<DC年金>	354,152,701円
コア資産形成ファンド	224,442,207円
MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	21,026,997,285円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	43,582,617,718円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	11,303,032,417円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	656,991,231円
計	451,050,455,847円
2. 受益権の総数	451,050,455,847口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券

<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>	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <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。</p>
-----------------------------------	---

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2641円 (12,641円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,038,057,279
コール・ローン	628,876,969
株式	1,019,902,152,748
投資信託受益証券	1,639,277,991
投資証券	19,908,092,956
派生商品評価勘定	31,654,059
未収入金	3,321,325
未収配当金	847,393,701
差入委託証拠金	8,191,259,422
流動資産合計	1,056,190,086,450
資産合計	1,056,190,086,450
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	142,086,874
未払金	41,258,166
未払解約金	504,126,000
流動負債合計	687,471,040
負債合計	687,471,040
純資産の部	
元本等	
元本	150,991,460,168
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	904,511,155,242
元本等合計	1,055,502,615,410
純資産合計	1,055,502,615,410
負債純資産合計	1,056,190,086,450

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
	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。	
	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
	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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4. 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	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	136,103,425,952円
同期中追加設定元本額	32,465,036,501円
同期中一部解約元本額	17,577,002,285円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,693,583,815円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	1,930,231円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	8,379,554円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	22,331,524円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	26,993,483円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	22,081,596円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	15,685,664円
たわらノーロード 先進国株式	48,640,775,751円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	316,152,881円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,881,790,349円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	859,953,854円
たわらノーロード バランス (堅実型)	83,363,008円
たわらノーロード バランス (標準型)	742,519,147円
たわらノーロード バランス (積極型)	959,971,615円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,335円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	34,007,692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)	217,730,256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)	223,196,319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)	382,893,442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)	293,555円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	14,050,802円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,564,460円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,025,785円
たわらノーロード 全世界株式	857,119,778円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,578,256,030円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	2,980,832,132円
O n e グローバルバランス	12,192,247円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	153,028,558円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	798,829,758円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,045,510,346円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	89,894,662円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	252,377,586円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	247,909,060円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,341,713円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	121,332,992円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	170,429,409円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	191,694,841円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	310,391,258円
投資のソムリエ	9,834,285,757円
クルーズコントロール	149,133,786円
投資のソムリエ<DC年金>	802,137,612円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	194,419,218円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	249,034,510円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	838,354,368円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,194,912,634円
ワールドアセットバランス (基本コース)	127,778,961円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	324,714,893円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	54,480,146円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	27,026,298円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	6,048,178円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	121,015,910円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	136,918,864円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	854,291,844円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	137,665,996円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	54,347,833円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	29,851,233円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	18,396,026円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	114,883,741円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,247,052円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	37,135,645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）	3,199,708円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	3,298,853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）	2,136,418円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	1,959,544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）	3,130,208円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	6,602,388円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	2,814,587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）	336,594,411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）	39,950,580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）	1,116,741,997円
DIAM先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,846,999円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,283,191,701円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	269,060,482円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	363,221円
DIAMワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	6,268,546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）	5,354,188円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,873,066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）	22,173,609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）	45,427,485円
DIAM国際分散バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,564,117円
DIAM国際分散バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	10,515,441円
DIAM国内重視バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,034,194円
DIAM国内重視バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	31,524円
DIAM世界バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	905,376円
DIAM世界バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	16,223,472円
DIAMバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	129,647,427円
DIAMバランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	223,776,704円
DIAMバランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	760,845,590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）	34,084,689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）	30,257,891円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	201,087,687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）	6,298,586円

D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	147, 610円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	84, 071, 905円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	8, 046, 043円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	25, 066, 520円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	38, 679, 437円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	83, 340, 298円
動的パッケージファンド<DC年金>	11, 266, 103円
コア資産形成ファンド	7, 091, 308円
MHAM外国株式インデックスファンド (ファンドラップ)	3, 114, 527, 284円
MHAM外国株式インデックスファンド	137, 750, 477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)	10, 641, 009円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1, 347, 359, 418円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1, 395, 422, 289円
計	150, 991, 460, 168円
2. 受益権の総数	150, 991, 460, 168口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年7月11日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	348, 054, 638	—	347, 547, 937	506, 701
アメリカ・ドル	276, 626, 610	—	276, 196, 262	430, 348
イギリス・ポンド	6, 733, 741	—	6, 733, 522	219

オーストラリア・ドル	15,493,947	—	15,420,759	73,188
カナダ・ドル	33,478,680	—	33,475,916	2,764
ユーロ	15,721,660	—	15,721,478	182
合計	348,054,638	—	347,547,937	506,701

(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。

①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。

②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	2023年7月11日現在			
	契約額等 (円)	時価 (円)		評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	13,832,638,529	—	13,721,699,013	△110,939,516
合計	13,832,638,529	—	13,721,699,013	△110,939,516

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額	6.9905円
(1万口当たり純資産額)	(69,905円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	684,396,912
コール・ローン	1,344,206,085
国債証券	220,206,717,091
派生商品評価勘定	36,229
未収入金	1,615,937,470
未収利息	1,406,877,090
前払費用	210,563,167
流動資産合計	225,468,734,044
資産合計	225,468,734,044
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,960,060
未払金	941,373,476
未払解約金	68,386,000
流動負債合計	1,014,719,536
負債合計	1,014,719,536
純資産の部	
元本等	
元本	104,763,290,199
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	119,690,724,309
元本等合計	224,454,014,508
純資産合計	224,454,014,508
負債純資産合計	225,468,734,044

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日
	至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	90,161,381,348円
同期中追加設定元本額	33,500,742,627円
同期中一部解約元本額	18,898,833,776円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,499,695,148円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,229,682円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	15,391,293円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	38,596,887円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	31,084,156円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	40,794,394円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	27,334,542円
たわらノーロード 先進国債券	18,153,706,469円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	246,831,565円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,760,294,818円
たわらノーロード バランス（堅実型）	67,067,884円
たわらノーロード バランス（標準型）	357,163,459円
たわらノーロード バランス（積極型）	77,315,848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）	16,297,265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）	993,839,511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）	1,731,211,128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）	833,105,152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）	517,877,468円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,785,025円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,367,553円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	189,055,586円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	15,095,958円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	23,204,613円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,664,662,650円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	1,028,947,577円

One グローバルバランス	40,070,255円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型	746,657,608円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	2,391,956,199円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型	2,684,302,273円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	423,631,209円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	779,070,256円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,420,160円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	895,628,565円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	35,241,998円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	159,329,380円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	154,850,470円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	248,203,562円
クルーズコントロール	1,346,975,128円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	675,693,591円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	646,072,045円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,400,956円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	371,894,929円
One グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	8,579,675円
One グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	78,149,920円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	1,031,313,518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)	97,508,740円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	99,918,494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)	127,490,675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)	60,517,247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)	95,603,282円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	206,325,819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)	417,486,928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)	86,516,318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)	427,801,018円
D I A M 為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,915,002,883円
D I A M 外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,397,314,344円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,058,371,359円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,278,146,097円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	124,533,142円
D I A M ワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	47,507,942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)	161,981,893円
D I A M グローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	345,527,019円
D I A M グローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限	235,871,672円

定)	
D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,849,941円
D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	22,750,991円
D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,717,019円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	50,848円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,408,616円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	35,101,490円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,473,780,949円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,349,266,910円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,469,584,496円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	55,047,529円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	114,048,383円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,315,768,264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)	226,180,224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)	159,112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)	272,879,218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)	251,171,098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)	360,717,023円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	35,674,740円
動的パッケージファンド<DC年金>	68,570,108円
コア資産形成ファンド	45,051,168円
MHAM外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	2,301,332,419円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	11,874,370,118円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	8,555,824,111円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,424,451,570円
計	104,763,290,199円
2. 受益権の総数	104,763,290,199口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年7月11日現在			
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	1,662,200,000	—	1,662,163,771	36,229
アメリカ・ドル	866,995,000	—	866,977,221	17,779
イギリス・ポンド	110,778,000	—	110,774,408	3,592
オーストラリア・ドル	40,000,000	—	39,995,434	4,566
カナダ・ドル	40,000,000	—	39,996,698	3,302
ユーロ	604,427,000	—	604,420,010	6,990
買建	836,499,000	—	831,538,940	△4,960,060
アメリカ・ドル	501,618,000	—	497,916,327	△3,701,673
イギリス・ポンド	37,692,000	—	37,538,455	△153,545
ユーロ	297,189,000	—	296,084,158	△1,104,842
合計	2,498,699,000	—	2,493,702,711	△4,923,831

(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。

①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。

②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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額	2,1425円
(1万口当たり純資産額)	(21,425円)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,208,949,637
コール・ローン	196,130,258
株式	103,465,619,699
投資信託受益証券	835,957,609
投資証券	102,071,127
派生商品評価勘定	2,616,836
未収入金	15,693,793
未収配当金	670,193,384
差入委託証拠金	1,077,907,542
流動資産合計	111,575,139,885
資産合計	111,575,139,885
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	64,072,796
未払金	380,547,534
未払解約金	394,867,000
流動負債合計	839,487,330
負債合計	839,487,330
純資産の部	
元本等	
元本	74,784,040,602
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	35,951,611,953
元本等合計	110,735,652,555
純資産合計	110,735,652,555
負債純資産合計	111,575,139,885

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
	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。	
	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
	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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4. 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	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	70,027,488,260円
同期中追加設定元本額	29,097,706,256円
同期中一部解約元本額	24,341,153,914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<DC年金>	9,354,540,072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)	5,506,091,550円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,736,252円

MITO ラップ型ファンド (中立型)	11,898,926円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	31,631,937円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	38,187,188円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	31,533,423円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,349,017円
たわらノーロード 新興国株式	11,862,668,282円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,883,213,268円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,980,683,377円
たわらノーロード バランス (堅実型)	32,014,725円
たわらノーロード バランス (標準型)	128,208,811円
たわらノーロード バランス (積極型)	223,528,960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)	5,456,273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)	92,756,228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)	157,404,115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)	240,618,659円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	67,321円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,470,189円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,511,910円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	7,700,590円
たわらノーロード 全世界株式	513,167,284円
One DC 新興国株式インデックスファンド	932,369,429円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	373,154,066円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	401,972,605円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	596,408,352円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	1,084,327,239円
投資のソムリエ	18,986,012,564円
クルーズコントロール	670,209,941円
投資のソムリエ<DC年金>	1,548,359,206円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	458,074,216円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,593,097,762円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,073,570,161円
ワールドアセットバランス (基本コース)	561,734,015円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,453,969,412円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	67,938,528円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	33,653,211円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	11,499,822円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	221,888,617円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,261,415,786円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	327,850,156円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	72,050,608円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	36,741,899円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	22,906,890円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,297,935円
One グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	25,910,135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)	10,390,617円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	519,386,127円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	7,498,046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)	197,751,409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)	91,070,400円
計	74,784,040,602円

2. 受益権の総数	74,784,040,602口
-----------	-----------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年7月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	723,449,765	—	720,832,929	2,616,836	
アメリカ・ドル	722,193,210	—	719,583,169	2,610,041	
コロンビア・ペソ	1,256,555	—	1,249,760	6,795	
買建	1,256,555	—	1,250,993	△5,562	
アメリカ・ドル	1,256,555	—	1,250,993	△5,562	
合計	724,706,320	—	722,083,922	2,611,274	

(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。

①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。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
 ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2023年7月11日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	5,986,657,222	—	—	5,922,589,988	△64,067,234
合計	5,986,657,222	—	—	5,922,589,988	△64,067,234

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.4807円
(1万口当たり純資産額)	(14,807円)

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,427,060,398
コール・ローン	244,211,851
国債証券	124,750,305,313
派生商品評価勘定	2,443,181
未収入金	849,453,154
未収利息	1,623,920,180
前払費用	306,642,754
流動資産合計	129,204,036,831
資産合計	129,204,036,831
負債の部	
流動負債	
未払金	937,420,055
未払解約金	366,338,000
流動負債合計	1,303,758,055
負債合計	1,303,758,055
純資産の部	
元本等	
元本	60,615,089,140
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	67,285,189,636
元本等合計	127,900,278,776
純資産合計	127,900,278,776
負債純資産合計	129,204,036,831

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
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. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	64,251,853,316円
同期中追加設定元本額	28,401,922,941円
同期中一部解約元本額	32,038,687,117円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	108,594,816円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,777,206,923円
たわらノーロード バランス (堅実型)	181,211,462円
たわらノーロード バランス (標準型)	540,841,267円
たわらノーロード バランス (積極型)	234,468,785円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	899,593円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	5,294,419円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	65,829,328円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,205,116円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	5,358,289円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	64,865,239円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	271,810,079円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	401,408,076円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	757,800,529円
投資のソムリエ	16,803,984,290円
クルーズコントロール	458,878,959円
投資のソムリエ<DC年金>	1,370,450,912円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	309,714,130円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,435,720,216円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,471,830,487円
ワールドアセットバランス (基本コース)	410,421,989円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,012,686,220円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	52,123,389円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	25,794,512円

リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	10,360,306円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	200,458,192円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,734,475,997円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	229,234,136円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	66,729,093円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	28,512,812円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	17,581,635円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	4,049,282円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	4,335,517円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	18,037,372円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	20,856,033,836円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	459,606,640円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,104,568,599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）	294,926,167円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）	6,637,919円
エマージング債券パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）	7,519,274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）	137,741,010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）	63,327,163円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,599,555,165円
計	60,615,089,140円
2. 受益権の総数	60,615,089,140口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年7月11日現在		
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）

市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	718,000,000	—	715,556,819	2,443,181
アメリカ・ドル	718,000,000	—	715,556,819	2,443,181
合計	718,000,000	—	715,556,819	2,443,181

(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。

①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。

②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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額	2,110円
(1万口当たり純資産額)	(21,100円)

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,359,197,680
投資証券	193,290,680,400
未収配当金	1,564,571,884
前払金	26,641,800
差入委託証拠金	260,575,500
流動資産合計	198,501,667,264
資産合計	198,501,667,264
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,360,370
未払金	699,604,342
未払解約金	50,236,000
流動負債合計	752,200,712
負債合計	752,200,712
純資産の部	
元本等	
元本	83,673,671,645
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	114,075,794,907
元本等合計	197,749,466,552
純資産合計	197,749,466,552
負債純資産合計	198,501,667,264

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日
	至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	85,187,544,308円
同期中追加設定元本額	22,030,557,666円
同期中一部解約元本額	23,544,430,329円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド (安定型)	208,574円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	904,493円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	2,418,527円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	2,911,947円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	2,397,178円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	1,714,895円
たわらノーロード 国内リート	5,683,656,076円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,089,845,532円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,549,448,190円
たわらノーロード バランス (堅実型)	41,835,696円
たわらノーロード バランス (標準型)	833,570,644円
たわらノーロード バランス (積極型)	944,380,509円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	274,407,128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)	658,427,733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)	473,640,709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)	541,611,633円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,566,745円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	60,871,536円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	5,832,466円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	16,092,617円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,387,588円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	473,699,700円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,803円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	143,513,616円

D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	218,451,664円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	417,605,680円
投資のソムリエ	7,267,573,271円
投資のソムリエ<DC年金>	592,435,741円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	162,621,843円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	570,352,680円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,175,828,832円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	43,802,411円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	21,695,251円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,115,232円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	128,498,293円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,874,973円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	46,375,182円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	23,833,827円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,771,373円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,323,065円
O n e グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	54,236,730円
J リートインデックスファンド(DC)	67,242,928円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	690,572,345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)	19,458,444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)	25,531,915円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	20,159,755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)	36,513,078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)	12,045,004円
固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)	188,600,781円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	81,809,338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)	74,737,399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)	19,111,387円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	48,125,279円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	21,267,135円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	33,018,339円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	24,876,523円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	81,757,540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)	17,219,285円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	24,628,650円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き） 2021-12（適格機関投資家限定）	33,661,538円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き） 2022-10（適格機関投資家限定）	182,297,040円
D I A M J - R E I T インデックスファンド（適格機関投資家向け）投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	3,469,265,369円 198,820,910円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	88,313,217円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	435,975,434円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	32,735,073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）	2,850,109円
D I A M 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）	1,063,688,919円
M H A M J - R E I T インデックスファンド（DC年金）	7,695,353,305円
M H A M J - R E I T インデックスファンド（毎月決算型）	36,642,688,120円
M H A M J - R E I T インデックスファンド（年1回決算型）	2,655,220,535円
M H A M J - R E I T インデックスファンド（ファンドラップ）	3,999,080,207円
計	83,673,671,645円
2. 受益権の総数	83,673,671,645口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2023年7月11日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引				
先物取引				

買建	4,315,036,800	—	4,312,933,500	△2,103,300
合計	4,315,036,800	—	4,312,933,500	△2,103,300

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.3633円
(1万口当たり純資産額)	(23,633円)

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)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	182,177,634
コール・ローン	48,796,860
投資信託受益証券	8,245,249,973
投資証券	74,112,975,343
派生商品評価勘定	2,088,118
未収入金	296,401,421
未収配当金	335,778,577
流動資産合計	83,223,467,926
資産合計	83,223,467,926
負債の部	
流動負債	
未払解約金	288,455,000
流動負債合計	288,455,000
負債合計	288,455,000
純資産の部	
元本等	
元本	48,011,706,851
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	34,923,306,075
元本等合計	82,935,012,926
純資産合計	82,935,012,926
負債純資産合計	83,223,467,926

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4. 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	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	41,342,647,392円
同期中追加設定元本額	27,052,792,922円
同期中一部解約元本額	20,383,733,463円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国RE 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)	2,359,055,190円
D I A M先進国RE 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)	33,861,385円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,659,197円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	15,921,123円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	42,327,253円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	51,173,014円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,166,889円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	29,946,247円
たわらノーロード 先進国リート	14,964,922,520円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,543,136,189円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	309,814,903円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,537,184,538円
たわらノーロード バランス (堅実型)	27,828,531円

たわらノーロード バランス (標準型)	554,012,496円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,169,947,437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)	91,687,301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)	644,894,803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)	546,968,837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)	937,996,499円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,191,148円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	49,195,702円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	7,201,937円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	28,349,243円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,668,780,254円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,109,378円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	690,947,972円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,534,103円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	214,120,117円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	312,458,906円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	572,289,726円
投資のソムリエ	9,748,405,506円
投資のソムリエ<DC年金>	794,872,472円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	240,510,446円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	638,301,586円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,432,552,807円
ワールドアセットバランス (基本コース)	347,351,219円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	852,243,993円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	46,556,405円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	23,096,585円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,607,867円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	113,361,073円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	175,420,383円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	48,490,239円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	25,511,955円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	15,719,728円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	3,628,889円
One グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	95,505,667円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	284,697,856円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	325,844,715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)	217,802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)	647,540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)	125,270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)	285,547円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	711,941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)	506,310円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	266,320,645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)	1,243,561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)	572,716円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）	3,841,263円
D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	51,459,367円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	171,459,920円
D I A M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）	770,952,740円
計	48,011,706,851円
2. 受益権の総数	48,011,706,851口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年7月11日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建					
アメリカ・ドル	340,333,220	—	338,245,102	2,088,118	
イギリス・ポンド	270,463,500	—	268,727,800	1,735,700	
オーストラリア・ドル	14,620,640	—	14,561,080	59,560	
オーストラリア・ドル	19,048,200	—	18,921,820	126,380	
カナダ・ドル	4,290,640	—	4,265,024	25,616	
シンガポール・ドル	9,519,840	—	9,474,966	44,874	
ユーロ	18,750,600	—	18,680,892	69,708	
香港・ドル	3,639,800	—	3,613,520	26,280	
合計	340,333,220	—	338,245,102	2,088,118	

（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。

①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中

値で評価しております。

②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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額	1,7274円
(1万口当たり純資産額)	(17,274円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

2023年7月31日現在

I 資産総額	11,418,700,375円
II 負債総額	7,627,150円
III 純資産総額（I－II）	11,411,073,225円
IV 発行済数量	6,756,888,262口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.6888円

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

2023年7月31日現在

I 資産総額	8,944,359,684円
II 負債総額	14,756,563円
III 純資産総額（I－II）	8,929,603,121円
IV 発行済数量	3,978,088,584口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.2447円

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

2023年7月31日現在

I 資産総額	11,154,333,724円
II 負債総額	23,258,587円
III 純資産総額（I－II）	11,131,075,137円
IV 発行済数量	3,815,227,423口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.9175円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	447,945,936,883円
II 負債総額	2,518,996,970円
III 純資産総額（I－II）	445,426,939,913円
IV 発行済数量	111,126,935,422口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.0083円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	467,335,608,865円
II 負債総額	1,904,080,000円
III 純資産総額（I－II）	465,431,528,865円
IV 発行済数量	372,209,838,461口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2505円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	1,103,895,940,927円
II 負債総額	24,692,014円
III 純資産総額（I－II）	1,103,871,248,913円
IV 発行済数量	151,889,838,118口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	7.2676円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	231,251,017,775円
II 負債総額	866,124,231円
III 純資産総額 (I - II)	230,384,893,544円
IV 発行済数量	106,810,495,017口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.1569円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	116,317,254,542円
II 負債総額	13,881,978円
III 純資産総額 (I - II)	116,303,372,564円
IV 発行済数量	74,127,211,107口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.5690円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	130,385,331,724円
II 負債総額	4,532,293,239円
III 純資産総額 (I - II)	125,853,038,485円
IV 発行済数量	58,605,672,986口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.1475円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	201,956,097,620円
II 負債総額	2,237,160,875円
III 純資産総額 (I - II)	199,718,936,745円
IV 発行済数量	83,647,117,304口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.3876円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	84,945,621,709円
II 負債総額	180,977,180円
III 純資産総額 (I - II)	84,764,644,529円
IV 発行済数量	48,099,912,969口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.7623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。

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2023年7月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2023年7月31日現在）

① 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。

② 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。

2023年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,552,827,736,355
追加型株式投資信託	783	15,353,432,764,987
単位型公社債投資信託	22	38,793,354,246
単位型株式投資信託	208	1,109,369,905,668
合計	1,039	18,054,423,761,256

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年5月25日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	31,421	33,770
金銭の信託	30,332	29,184
未収委託者報酬	17,567	16,279
未収運用受託報酬	4,348	3,307
未収投資助言報酬	309	283
未収収益	5	15
前払費用	1,167	1,129
その他	2,673	2,377
流動資産計	87,826	86,346
固定資産		
有形固定資産	1,268	1,127
建物	※1 1,109	※1 1,001
器具備品	※1 158	※1 118
リース資産	-	※1 7
無形固定資産	4,561	5,021
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産	10,153	9,768
投資有価証券	241	182
関係会社株式	5,349	5,810
長期差入保証金	1,102	775
繰延税金資産	3,092	2,895
その他	367	104
固定資産計	15,983	15,918
資産合計	103,810	102,265

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		13		10
受取配当金	※1	559	※1	2,400
時効成立分配金・償還金		0		0
為替差益		7		—
雑収入		19		10
時効後支払損引当金戻入額		10		24
営業外収益計		610		2,446
営業外費用				
為替差損		—		3
金銭の信託運用損		743		1,003
早期割増退職金		20		24
雑損失		—		47
営業外費用計		764		1,079
経常利益		22,694		19,502
特別利益				
固定資産売却益		0		—
投資有価証券売却益		—		4
特別利益計		0		4
特別損失				
固定資産除却損		5		12
投資有価証券売却損		6		9
ゴルフ会員権売却損		3		—
オフィス再編費用	※2	509		—
関係会社株式評価損		—		584
特別損失計		525		606
税引前当期純利益		22,169		18,900
法人税、住民税及び事業税		6,085		4,881
法人税等調整額		584		197
法人税等合計		6,669		5,078
当期純利益		15,499		13,821

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：百万円)

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

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			△12,360
当期純利益			13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	1,461
当期末残高	△0	△0	79,034

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>②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	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

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

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過の取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、(金融商品会計)注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

注記事項

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	—	1

(損益計算書関係)

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

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
受取配当金	543	2,393

※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2023年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①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います。

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います。

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	29,184	29,184	—
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	—
資産計	29,186	29,186	—

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

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	33,770	—	—	—
(2) 金銭の信託	29,184	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	16,279	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	3,307	—	—	—
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	—	1	—	—
合計	82,540	1	—	—

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第37期（2022年3月31日現在）

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

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

第38期（2023年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	—	29,184	—	29,184
(2) 投資有価証券 その他有価証券	—	—	—	—
資産計	—	29,186	—	29,186

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としておりません。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

(百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	239	180
関係会社株式 非上場株式	5,349	5,810

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第37期（2022年3月31日現在）

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

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

第38期（2023年3月31日現在）

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額180百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)	
	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△14	31
退職給付の支払額	△185	△191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(百万円)	
	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	△35	△44
未認識過去勤務費用	△33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	△3	△4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において20百万円、当事業年度において24百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%~3.76%	1.00%~3.56%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度97百万円、当事業年度103百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額 (一括償却資産)	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額 (税法上)	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	<u>3,092</u>	<u>2,895</u>
繰延税金負債	<u>—</u>	<u>—</u>
繰延税金負債合計	<u>—</u>	<u>—</u>
繰延税金資産の純額	<u>3,092</u>	<u>2,895</u>

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
法定実効税率	—	30.62 %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	—	△3.69 %
その他	—	△0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>—</u>	<u>26.87 %</u>

(注) 前事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A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」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

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

のれん	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

(2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,429百万円	△8,039百万円
経常利益	△8,429百万円	△8,039百万円
税引前当期純利益	△8,429百万円	△8,039百万円
当期純利益	△7,015百万円	△6,744百万円
1株当たり当期純利益	△175,380円68銭	△168,617円97銭

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,618百万円	4,228百万円

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬(注)	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

(注) 成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 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。

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(持分法損益等)

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	7,474	未払 手数料	1,579
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	13,932	未払 手数料	2,404

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19銭

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

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

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

約 款

追加型証券投資信託
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

主として、以下のマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とします。

1. 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
2. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. エマージング株式パッシブ・マザーファンド
6. エマージング債券パッシブ・マザーファンド
7. J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
8. 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

(2) 投資態度

- ①主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。
- ②次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。

＜基本アロケーション＞

国内株式 10%+国内債券57%+先進国株式（除く日本） 10%+先進国債券（除く日本） 3%+新興国株式5%+新興国債券 5%+国内不動産投資信託証券 3%+先進国不動産投資信託証券（除く日本） 3%+短期金融資産 4%

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託者が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下の通りです。

1. 国内株式：東証株価指数(T O P I X) (配当込み)
2. 国内債券：N O M U R A - B P I 総合
3. 先進国株式（除く日本）：M S C I 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）
4. 先進国債券（除く日本）：F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）
5. 新興国株式：M S C I エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
6. 新興国債券：J P 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）
7. 国内不動産投資信託証券：東証R E I T 指数（配当込み）
8. 先進国不動産投資信託証券（除く日本）：S & P 先進国 R E I T 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)

9. 短期金融資産：コール・ローン（オーバーナイト物）

- ③マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。
- ④実質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。
- ⑤上記にかかわらず、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、および純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

- ①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。
- ②スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引、為替先渡取引および有価証券先物取引等は約款の範囲内で行うことができます。
- ③外貨建資産への実質投資割合については、制限を設けません。
- ④非株式への実質投資割合については、制限を設けません。
- ⑤一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、委託者は、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。

3. 収益分配方針

毎決算時に、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

委託者が基準価額水準、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、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

<信託の目的および金額>

第3条 委託者は、金50万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

<信託金の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として、信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項、第51条第2項の規定による信託終了の日までとします。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<受益権の分割および再分割>

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については50万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところにしたがい、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。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②この約款において基準価額とは、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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除し

た金額をいいます。

- ③外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④第27条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第11条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及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、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、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。）。

- ②委託者は、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、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、委託者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。
- ③委託者は、第8条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者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。

<受益権の設定にかかる受託者の通知>

第12条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、また、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。

<受益権の申込単位および取得価額等>

第13条 委託者は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口または1円を最低単位として取得の申込みに応じることができます。

- ②販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口または1円を最低単位として取得申込みに応じることができるものとします。
- ③前2項にかかわらず、取得申込日が別に定める海外休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。
- ④第1項および第2項の場合の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる取得価額は、1口につき1円とします。
- ⑤前項の規定にかかわらず、受益者が第42条第1項の規定または別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

- ⑥第1項および第2項の取得申込者は委託者または販売会社に、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この信託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、委託者（第44条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）または販売会社は、当該取得申込みの代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）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、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡にかかる記載または記録>

- 第14条 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、
- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、ただし、前項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、
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

<受益権の譲渡の対抗要件>

- 第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

- 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、
- 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。）
 - 有価証券
 - 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、）
 - 金銭債権
 - 約束手形
 - 次に掲げる特定資産以外の資産
 - 為替手形

<運用の指図範囲等>

- 第17条 委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された証券投資信託である国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・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、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド（以下それぞれを「各マザー

ファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。) 各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、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せん。)
 8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、前各号の証券または証券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券(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. 預託証券(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券
 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前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証券、第13号および第18号の証券または証券のうち第1号の証券または証券の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第7号までの証券ならびに第13号および第18号の証券または証券のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号の証券および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。また、「不動産投資信託証券」とは、「投資信託証券」のうち一般社団法人投資信託協会規則に定めるものをいいます。
- ②委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの
- ③委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。以下同じ。)を除きます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ④前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<利害関係人等との取引等>

- 第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者(第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。)および受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第28条において同じ。)、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等(金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。)または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託者は、委託者の指図により、当該投資等および当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

<運用の基本方針>

- 第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

- 第20条 委託者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(上場予定を含みます。)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前項の規定にかかわらず、上場予定の株式、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されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第20条の2 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100分の10、合計で100分の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、委託者は、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。

<信用取引の指図範囲>

第21条 委託者は、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前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号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>

第22条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

- ②委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

<スワップ取引の運用指図>

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を

超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- ③スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、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たときは、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>

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、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たときは、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>

第24条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付の指図および範囲>

第25条 委託者は、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各号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前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、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>

第26条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約取引の指図>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その越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。

<信託業務の委託等>

第28条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

<混蔵寄託>

第29条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第30条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、信託財産に属する旨の記載または記録に代えてその計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第31条 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第32条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第33条 委託者は、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。

<損益の帰属>

第34条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第35条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第36条 この信託の計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から平成25年1月11日までとします。

②前項にかかわらず、前項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、第5条に定める信託期間の終了日とします。

<信託財産に関する報告等>

第37条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

<信託事務の諸費用および監査費用>

第38条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ②信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該監査費用にかかる消費税ならびに地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

<信託報酬等の額および支弁の方法>

第39条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年10,000分の31.5の率を乗じて得た額とします。

- ②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者の間の配分は別に定めます。
- ③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第40条 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前項第1号および第2号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、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第41条 受託者は、収益分配金については毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第43条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第43条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

第42条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込に応じるものとします。当該受益権の取得申込に応じることにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ②別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定す

る預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。

- ③販売会社は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に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けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ④収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- ⑤前項および第43条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、前項および第43条第4項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

- 第43条 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から信託終了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（信託終了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、当該信託終了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者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。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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。
- ②一部解約金は、第46条第1項の受益者の請求を受けた日から起算して、原則として6営業日目から当該受益者に支払います。
 - ③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとします。
 - ④償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<委託者自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第44条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

<収益分配金および償還金の時効>

第45条 受益者が、収益分配金について支払い開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第43条第1項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

- 第46条 受益者（販売会社を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日が別に定める海外休業日のいずれかに該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。
- ②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、信託契約の一部を解約します。な

お、前項の一部解約の実行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信託契約の一部解約を委託者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。

- ③前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。
- ④一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑤委託者は、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、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。

<信託契約の解約>

第47条 委託者は、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有利であると認めるとき、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

- ②委託者は、前項の事項について、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。
- ③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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。
- ④第2項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。
- ⑤第2項から前項までの規定は、委託者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又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、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第48条 委託者は、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。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの約款を変更しようとするときは、第52条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第49条 委託者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、委託者は、信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第52条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者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第50条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を承継させることがあります。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第51条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者が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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第52条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、本項による場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は信託契約を解約し、信託を終了させます。

<信託約款の変更等>

第52条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、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け出ます。なお、この約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、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、この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。

③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④第2項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。

⑤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。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者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、この約款にかかるすべての受益者が書面又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。

⑦前各項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つても、当該併合にかかる一又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。

<反対受益者の受益権買取請求の不適用>

第53条 この信託は、受益者が第46条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者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、第47条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

<他の受益者の氏名等の開示の請求の制限>

第54条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

<公告>

第55条 委託者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、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am-one.co.jp/>

- ②前項の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ます。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第56条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<質権口記載又は記録の受益権の取扱い>

第57条 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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

<約款に関する疑義の取扱い>

第58条 この約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第3条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する

取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成24年9月6日 (信託契約締結日)

委託者 D I A Mアセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

約 款 付 表

1. 別に定める海外休業日

約款第13条第3項および第46条第1項の「別に定める海外休業日」とは、以下のいずれかに該当する日をいいます。

- (1) ニューヨーク証券取引所の休業日
- (2) ロンドン証券取引所の休業日
- (3) フランクフルト証券取引所の休業日
- (4) 香港証券取引所の休業日
- (5) 韓国取引所の休業日
- (6) ニューヨークの銀行の休業日
- (7) ロンドンの銀行の休業日
- (8) フランクフルトの銀行の休業日
- (9) 香港の銀行の休業日
- (10) 韓国の銀行の休業日

約 款

追加型証券投資信託
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

主として、以下のマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とします。

1. 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
2. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. エマージング株式パッシブ・マザーファンド
6. エマージング債券パッシブ・マザーファンド
7. J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
8. 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

(2) 投資態度

- ①主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。
- ②次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。

＜基本アロケーション＞

国内株式 15%+国内債券31%+先進国株式（除く日本） 15%+先進国債券（除く日本） 4%+新興国株式10%+新興国債券 10%+国内不動産投資信託証券6%+先進国不動産投資信託証券（除く日本） 6%+短期金融資産3%

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託者が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下の通りです。

1. 国内株式：東証株価指数(T O P I X) (配当込み)
2. 国内債券：N O M U R A - B P I 総合
3. 先進国株式（除く日本）：M S C I 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）
4. 先進国債券（除く日本）：F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）
5. 新興国株式：M S C I エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
6. 新興国債券：J P 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）
7. 国内不動産投資信託証券：東証R E I T 指数（配当込み）
8. 先進国不動産投資信託証券（除く日本）：S & P 先進国 R E I T 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)

9. 短期金融資産：コール・ローン（オーバーナイト物）

- ③マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。
- ④実質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。
- ⑤上記にかかわらず、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、および純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

- ①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。
- ②スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引、為替先渡取引および有価証券先物取引等は約款の範囲内で行うことができます。
- ③外貨建資産への実質投資割合については、制限を設けません。
- ④非株式への実質投資割合については、制限を設けません。
- ⑤一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、委託者は、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。

3. 収益分配方針

毎決算時に、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

委託者が基準価額水準、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、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

<信託の目的および金額>

第3条 委託者は、金50万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

<信託金の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として、信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項、第51条第2項の規定による信託終了の日までとします。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<受益権の分割および再分割>

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については50万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところにしたがい、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。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②この約款において基準価額とは、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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除し

た金額をいいます。

- ③外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④第27条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第11条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及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、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、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。）。

- ②委託者は、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、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、委託者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。
- ③委託者は、第8条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者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。

<受益権の設定にかかる受託者の通知>

第12条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、また、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。

<受益権の申込単位および取得価額等>

第13条 委託者は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口または1円を最低単位として取得の申込みに応じることができます。

- ②販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口または1円を最低単位として取得申込みに応じることができるものとします。
- ③前2項にかかわらず、取得申込日が別に定める海外休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。
- ④第1項および第2項の場合の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる取得価額は、1口につき1円とします。
- ⑤前項の規定にかかわらず、受益者が第42条第1項の規定または別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

- ⑥第1項および第2項の取得申込者は委託者または販売会社に、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この信託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、委託者（第44条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）または販売会社は、当該取得申込みの代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）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、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡にかかる記載または記録>

第14条 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、

②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、ただし、前項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、

③委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

<受益権の譲渡の対抗要件>

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

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、

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第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
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第17条 委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された証券投資信託である国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・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、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド（以下それぞれを「各マザー

ファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。) 各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、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せん。)
 8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、前各号の証券または証券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券(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. 預託証券(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券
 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前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証券、第13号および第18号の証券または証券のうち第1号の証券または証券の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第7号までの証券ならびに第13号および第18号の証券または証券のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号の証券および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。また、「不動産投資信託証券」とは、「投資信託証券」のうち一般社団法人投資信託協会規則に定めるものをいいます。
- ②委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの
- ③委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。以下同じ。)を除きます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ④前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<利害関係人等との取引等>

- 第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者(第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。)および受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第28条において同じ。)、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等(金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。)または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託者は、委託者の指図により、当該投資等および当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

<運用の基本方針>

- 第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

- 第20条 委託者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(上場予定を含みます。)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前項の規定にかかわらず、上場予定の株式、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されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第20条の2 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100分の10、合計で100分の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、委託者は、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。

<信用取引の指図範囲>

第21条 委託者は、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前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）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（前号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>

第22条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

- ②委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

<スワップ取引の運用指図>

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を

超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- ③スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、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たときは、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>

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、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たときは、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>

第24条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付の指図および範囲>

第25条 委託者は、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各号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前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、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>

第26条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約取引の指図>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その越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。

<信託業務の委託等>

第28条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

<混蔵寄託>

第29条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第30条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、信託財産に属する旨の記載または記録に代えてその計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第31条 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第32条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第33条 委託者は、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。

<損益の帰属>

第34条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第35条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第36条 この信託の計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から平成25年1月11日までとします。

②前項にかかわらず、前項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、第5条に定める信託期間の終了日とします。

<信託財産に関する報告等>

第37条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

<信託事務の諸費用および監査費用>

第38条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ②信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該監査費用にかかる消費税ならびに地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

<信託報酬等の額および支弁の方法>

第39条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年10,000分の34.5の率を乗じて得た額とします。

- ②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者の間の配分は別に定めます。
- ③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第40条 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前項第1号および第2号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、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第41条 受託者は、収益分配金については毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第43条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第43条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

第42条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込に応じるものとします。当該受益権の取得申込に応じることにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ②別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定す

る預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。

- ③販売会社は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に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けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ④収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- ⑤前項および第43条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、前項および第43条第4項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第43条 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から信託終了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（信託終了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、当該信託終了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者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。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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。

- ②一部解約金は、第46条第1項の受益者の請求を受けた日から起算して、原則として6営業日目から当該受益者に支払います。
- ③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとします。
- ④償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<委託者自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第44条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

<収益分配金および償還金の時効>

第45条 受益者が、収益分配金について支払い開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第43条第1項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

第46条 受益者（販売会社を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日が別に定める海外休業日のいずれかに該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- ②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、信託契約の一部を解約します。な

お、前項の一部解約の実行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信託契約の一部解約を委託者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。

- ③前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。
- ④一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑤委託者は、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、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。

<信託契約の解約>

第47条 委託者は、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有利であると認めるとき、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

- ②委託者は、前項の事項について、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。
- ③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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。
- ④第2項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。
- ⑤第2項から前項までの規定は、委託者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又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、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第48条 委託者は、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。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの約款を変更しようとするときは、第52条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第49条 委託者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、委託者は、信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第52条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者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第50条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を承継させることがあります。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第51条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者が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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第52条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、本項による場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は信託契約を解約し、信託を終了させます。

<信託約款の変更等>

第52条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、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け出ます。なお、この約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、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、この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。

③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④第2項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。

⑤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。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者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、この約款にかかるすべての受益者が書面又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。

⑦前各項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つても、当該併合にかかる一又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。

<反対受益者の受益権買取請求の不適用>

第53条 この信託は、受益者が第46条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者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、第47条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

<他の受益者の氏名等の開示の請求の制限>

第54条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

<公告>

第55条 委託者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、次のアドレスに掲載します。
<https://www.am-one.co.jp/>

- ②前項の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ます。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第56条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<質権口記載又は記録の受益権の取扱い>

第57条 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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<約款に関する疑義の取扱い>

第58条 この約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第3条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する

取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成24年9月6日 (信託契約締結日)

委託者 D I A Mアセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

約 款 付 表

1. 別に定める海外休業日

約款第13条第3項および第46条第1項の「別に定める海外休業日」とは、以下のいずれかに該当する日をいいます。

- (1) ニューヨーク証券取引所の休業日
- (2) ロンドン証券取引所の休業日
- (3) フランクフルト証券取引所の休業日
- (4) 香港証券取引所の休業日
- (5) 韓国取引所の休業日
- (6) ニューヨークの銀行の休業日
- (7) ロンドンの銀行の休業日
- (8) フランクフルトの銀行の休業日
- (9) 香港の銀行の休業日
- (10) 韓国の銀行の休業日

約 款

追加型証券投資信託
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

主として、以下のマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とします。

1. 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
2. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. エマージング株式パッシブ・マザーファンド
6. エマージング債券パッシブ・マザーファンド
7. J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
8. 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

(2) 投資態度

- ①主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。
- ②次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。

＜基本アロケーション＞

国内株式 20%+国内債券5%+先進国株式（除く日本） 20%+先進国債券（除く日本） 5%+新興国株式15%+新興国債券 15%+国内不動産投資信託証券9%+先進国不動産投資信託証券（除く日本）9%+短期金融資産2%

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託者が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下の通りです。

1. 国内株式：東証株価指数(T O P I X) (配当込み)
2. 国内債券：N O M U R A - B P I 総合
3. 先進国株式（除く日本）：M S C I 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）
4. 先進国債券（除く日本）：F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）
5. 新興国株式：M S C I エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
6. 新興国債券：J P 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）
7. 国内不動産投資信託証券：東証R E I T 指数（配当込み）
8. 先進国不動産投資信託証券（除く日本）：S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、円

換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)

9. 短期金融資産：コール・ローン（オーバーナイト物）

- ③マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。
- ④実質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。
- ⑤上記にかかわらず、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、および純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

- ①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。
- ②スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引、為替先渡取引および有価証券先物取引等は約款の範囲内で行うことができます。
- ③外貨建資産への実質投資割合については、制限を設けません。
- ④非株式への実質投資割合については、制限を設けません。
- ⑤一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、委託者は、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。

3. 収益分配方針

毎決算時に、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

委託者が基準価額水準、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、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

<信託の目的および金額>

第3条 委託者は、金50万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

<信託金の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として、信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項、第51条第2項の規定による信託終了の日までとします。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<受益権の分割および再分割>

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については50万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところにしたがい、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。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②この約款において基準価額とは、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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除し

た金額をいいます。

- ③外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④第27条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第11条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及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、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、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。）。

- ②委託者は、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、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、委託者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。
- ③委託者は、第8条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者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。

<受益権の設定にかかる受託者の通知>

第12条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、また、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。

<受益権の申込単位および取得価額等>

第13条 委託者は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口または1円を最低単位として取得の申込みに応じることができます。

- ②販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口または1円を最低単位として取得申込みに応じることができるものとします。
- ③前2項にかかわらず、取得申込日が別に定める海外休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。
- ④第1項および第2項の場合の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる取得価額は、1口につき1円とします。
- ⑤前項の規定にかかわらず、受益者が第42条第1項の規定または別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

- ⑥第1項および第2項の取得申込者は委託者または販売会社に、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この信託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、委託者（第44条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）または販売会社は、当該取得申込みの代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）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、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡にかかる記載または記録>

第14条 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、

②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、ただし、前項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、

③委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

<受益権の譲渡の対抗要件>

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

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、

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第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
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第17条 委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された証券投資信託である国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・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、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド（以下それぞれを「各マザー

ファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。) 各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、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せん。)
 8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号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. 預託証券(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券
 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前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第13号および第18号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第7号までの証券ならびに第13号および第18号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号の証券および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。また、「不動産投資信託証券」とは、「投資信託証券」のうち一般社団法人投資信託協会規則に定めるものをいいます。
- ②委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの
- ③委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。以下同じ。)を除きます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ④前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<利害関係人等との取引等>

- 第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者(第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。)および受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第28条において同じ。)、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等(金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。)または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託者は、委託者の指図により、当該投資等および当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

<運用の基本方針>

- 第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

- 第20条 委託者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(上場予定を含みます。)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前項の規定にかかわらず、上場予定の株式、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されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第20条の2 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100分の10、合計で100分の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、委託者は、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。

<信用取引の指図範囲>

第21条 委託者は、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前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）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（前号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>

第22条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

- ②委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

<スワップ取引の運用指図>

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を

超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- ③スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、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たときは、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>

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、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たときは、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>

第24条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付の指図および範囲>

第25条 委託者は、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各号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前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、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>

第26条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約取引の指図>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その越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。

<信託業務の委託等>

第28条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

<混蔵寄託>

第29条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第30条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、信託財産に属する旨の記載または記録に代えてその計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第31条 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第32条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第33条 委託者は、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。

<損益の帰属>

第34条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第35条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第36条 この信託の計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から平成25年1月11日までとします。

②前項にかかわらず、前項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、第5条に定める信託期間の終了日とします。

<信託財産に関する報告等>

第37条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

<信託事務の諸費用および監査費用>

第38条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該監査費用にかかる消費税ならびに地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

<信託報酬等の額および支弁の方法>

第39条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年10,000分の37.5の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者の間の配分は別に定めます。

③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第40条 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前項第1号および第2号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、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第41条 受託者は、収益分配金については毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第43条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第43条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

第42条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込に応じるものとします。当該受益権の取得申込に応じることにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

②別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定す

る預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。

- ③販売会社は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に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けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ④収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- ⑤前項および第43条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、前項および第43条第4項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

- 第43条 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から信託終了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（信託終了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、当該信託終了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者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。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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。
- ②一部解約金は、第46条第1項の受益者の請求を受けた日から起算して、原則として6営業日目から当該受益者に支払います。
 - ③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとします。
 - ④償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<委託者自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第44条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

<収益分配金および償還金の時効>

第45条 受益者が、収益分配金について支払い開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第43条第1項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

- 第46条 受益者（販売会社を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日が別に定める海外休業日のいずれかに該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。
- ②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、信託契約の一部を解約します。な

お、前項の一部解約の実行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信託契約の一部解約を委託者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。

- ③前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。
- ④一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑤委託者は、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、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。

<信託契約の解約>

第47条 委託者は、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有利であると認めるとき、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

- ②委託者は、前項の事項について、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。
- ③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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。
- ④第2項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。
- ⑤第2項から前項までの規定は、委託者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又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、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第48条 委託者は、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。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの約款を変更しようとするときは、第52条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第49条 委託者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、委託者は、信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第52条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者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第50条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を承継させることがあります。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第51条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者が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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第52条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、本項による場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は信託契約を解約し、信託を終了させます。

<信託約款の変更等>

第52条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、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け出ます。なお、この約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、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、この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。

③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④第2項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。

⑤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。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者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、この約款にかかるすべての受益者が書面又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。

⑦前各項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つても、当該併合にかかる一又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。

<反対受益者の受益権買取請求の不適用>

第53条 この信託は、受益者が第46条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者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、第47条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

<他の受益者の氏名等の開示の請求の制限>

第54条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

<公告>

第55条 委託者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、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am-one.co.jp/>

- ②前項の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ます。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第56条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<質権口記載又は記録の受益権の取扱い>

第57条 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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<約款に関する疑義の取扱い>

第58条 この約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第3条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する

取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成24年9月6日 (信託契約締結日)

委託者 D I A Mアセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

約 款 付 表

1. 別に定める海外休業日

約款第13条第3項および第46条第1項の「別に定める海外休業日」とは、以下のいずれかに該当する日をいいます。

- (1) ニューヨーク証券取引所の休業日
- (2) ロンドン証券取引所の休業日
- (3) フランクフルト証券取引所の休業日
- (4) 香港証券取引所の休業日
- (5) 韓国取引所の休業日
- (6) ニューヨークの銀行の休業日
- (7) ロンドンの銀行の休業日
- (8) フランクフルトの銀行の休業日
- (9) 香港の銀行の休業日
- (10) 韓国の銀行の休業日

親投資信託
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
- 6) 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- 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、委託者は、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。

親投資信託
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
- 2) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 5) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 6) 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
- 7) スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
- 8) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
- 9) 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行いません。
- 10) 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。
- 11) 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。

- 12) 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、委託者は、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。

親投資信託
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 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）に連動する投資成果を目指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。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 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、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、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) 有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。
- 8) 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。

9) 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。

10) 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、委託者は、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。

親投資信託
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第15条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 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。
- 3) 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
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) 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。
- 3) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- 5) 有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

- 8) 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行ないます。
- 9) 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。
- 10) 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。
- 11) 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、委託者は、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。

親投資信託
エマージング株式パッシブ・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

（*）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及び証書等を含みます。

2. 運用方法

（1）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。

（*）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及び証書等を含みます。

（2）投資態度

①主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指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。

④信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

⑤ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

（3）投資制限

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有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引は約款の範囲内で行うことができます。

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、委託者は、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。

親投資信託
エマージング債券パッシブ・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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、J P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目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

- ①主として新興国の債券に投資し、J P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目指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一格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。
- 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。
- ⑤信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- ⑥ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

（3）投資制限

- 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有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引は約款の範囲内で行うことができます。
- 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、委託者は、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。

親投資信託
J-REITインデックスファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。

2. 運用方法

(1) 投資対象

東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 運用制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。
- ③株式への投資は行いません。
- ④外貨建資産への投資は行いません。
- 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。
- 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、委託者は、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。

親投資信託
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 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目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 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（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。）とします。

(2) 投資態度

- 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目指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。
- ④市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③株式への直接投資は行いません。
- ④同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
- ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。