

使用開始日
2024年2月14日

リスクコントロール 世界資産分散ファンド

愛称: マイスタート

追加型投信/内外/資産複合

■この目論見書により行う「リスクコントロール世界資産分散ファンド」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2024年2月13日に関東財務局長に提出しており、2024年2月14日にその効力が生じております。

■「リスクコントロール世界資産分散ファンド」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】	5
第1【ファンドの状況】	5
第2【管理及び運営】	80
第3【ファンドの経理状況】	88
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	307
第三部【委託会社等の情報】	309
第1【委託会社等の概況】	309
約款	355

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

リスクコントロール世界資産分散ファンド

ただし、愛称として「マイスタート」という名称を用いる場合があります。

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

<基準価額の照会方法等>

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <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）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

(5) 【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.1% (税抜1.0%) を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2024年2月14日から2024年8月13日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <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）

(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、販売会社を買付代金を支払うものとします。

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <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）

（11）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（12）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

なお、委託会社または販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。
- ②当ファンドの信託金限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 国内外の8資産に分散投資を行い、中長期的に安定的なリターンの獲得をめざします。

●主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)の8資産にマザーファンド*1を通じて投資します。*2*3

*1 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・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、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド

*2 一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

*3 有価証券指数等先物等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)へ直接投資する場合があります。

また、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

2 基本資産配分によるポートフォリオの変動リスク*1を年率2%程度*2に抑えた安定的な運用をめざします。

●各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産の収益率のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度となるよう最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

●通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

*1 価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

*2 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

3 基準価額の下落を一定水準(下値目安値*¹)までに抑えることをめざします。

●基本配分比率をもとに分散投資を行いつつ、基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率*²を機動的に変更します。

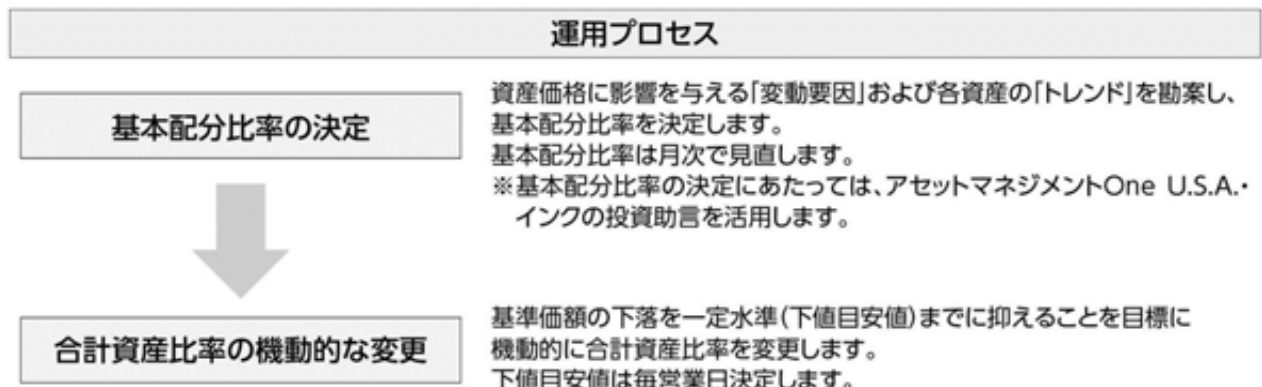
下値目安値は、過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

*2 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

4 年1回決算を行います。

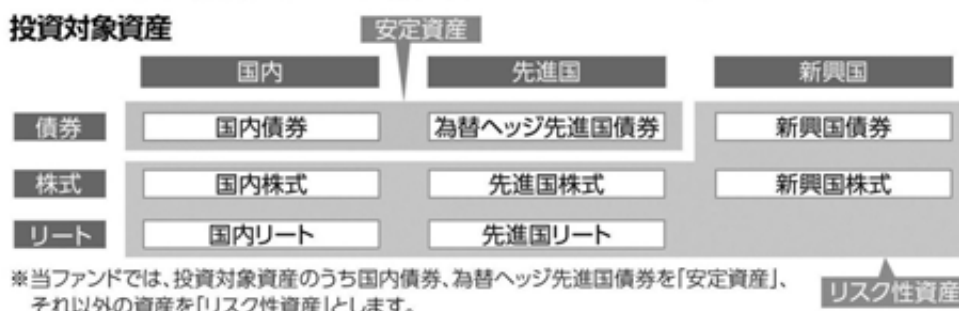
●毎年11月11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。



リスクを抑えるための2つの運用手法により、安定的なリターンをめざします。

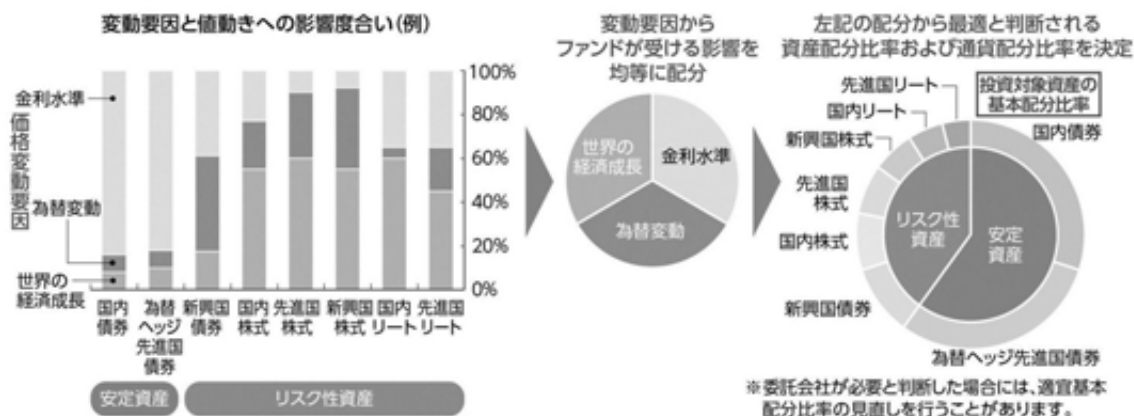


当ファンドでは、投資対象資産である国内外の8資産に対して、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目した分散投資を行うことで、特定の要因で大きく基準価額が変動するリスクを回避し、変動を抑えて運用を行うことをめざします。



当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

資産価格に影響を与える変動要因を判定し、変動要因の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産のトレンドを勘案した上で、基準価額の変動が小さくなるように最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は、月次で決定し、原則月間を通じて維持します。通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円で為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。



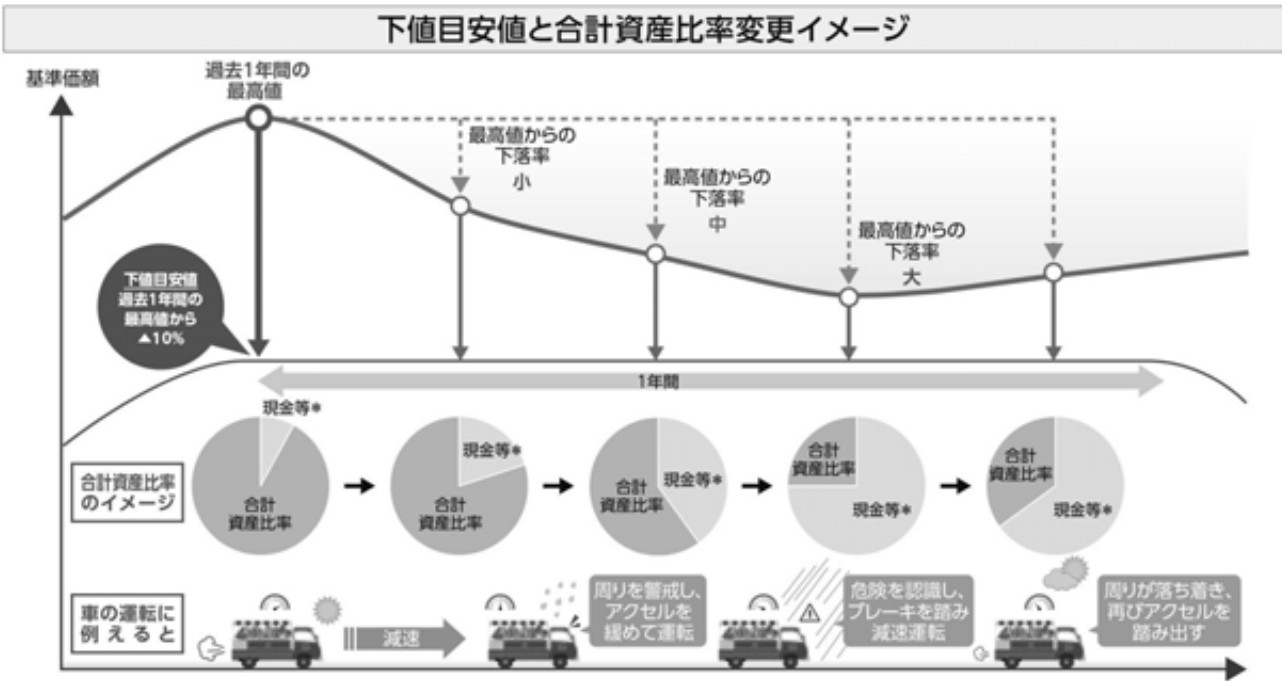
価格変動要因が変化した場合



※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。



当ファンドでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等には、現金等の比率を増やすことで基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることをめざします。



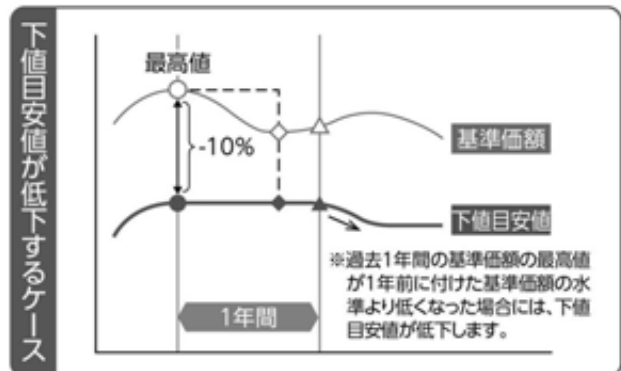
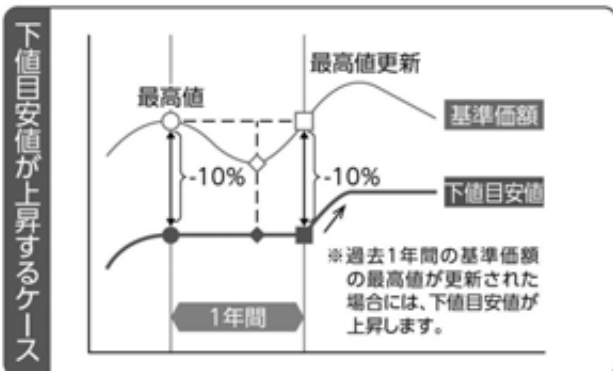
*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じて、または直接投資を行います。

*合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

下値目安値について

下値目安値は過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

※設定後1年に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。



※下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去1年間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去1年間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

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

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

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年11月11日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた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>

・商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

追加型	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う。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内およ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う。
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う。

<属性区分>

・属性区分表

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (一部ヘッジ)
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (債券、 株式、不動産投信) 資産配分変更型))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注1) 「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2) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））	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、主として複数資産（債券、株式、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、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年 1 回	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う。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(注1) 商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

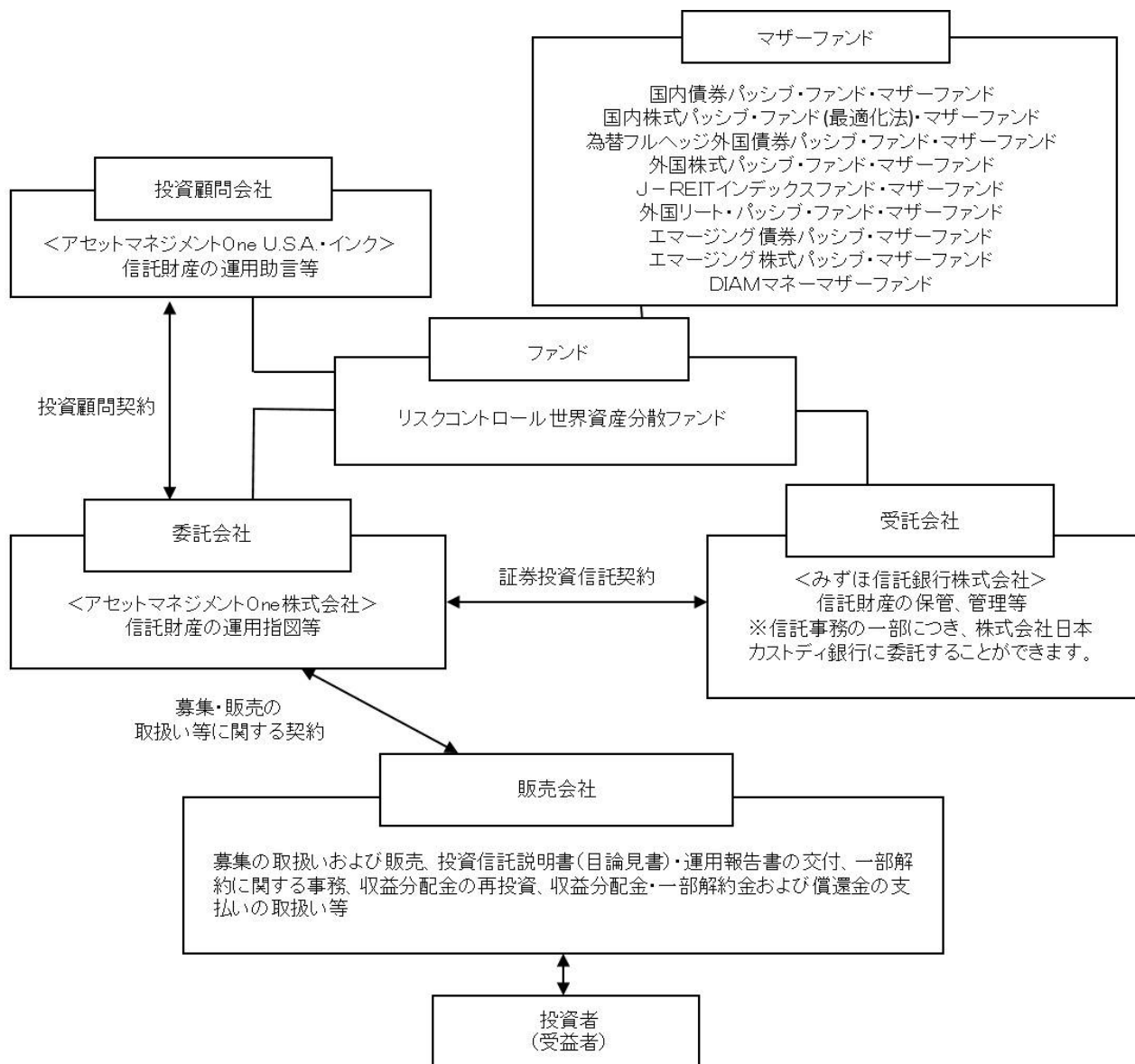
(注2) 当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

(注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式、不動産投信を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

(2) 【ファンドの沿革】

2018年5月25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、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

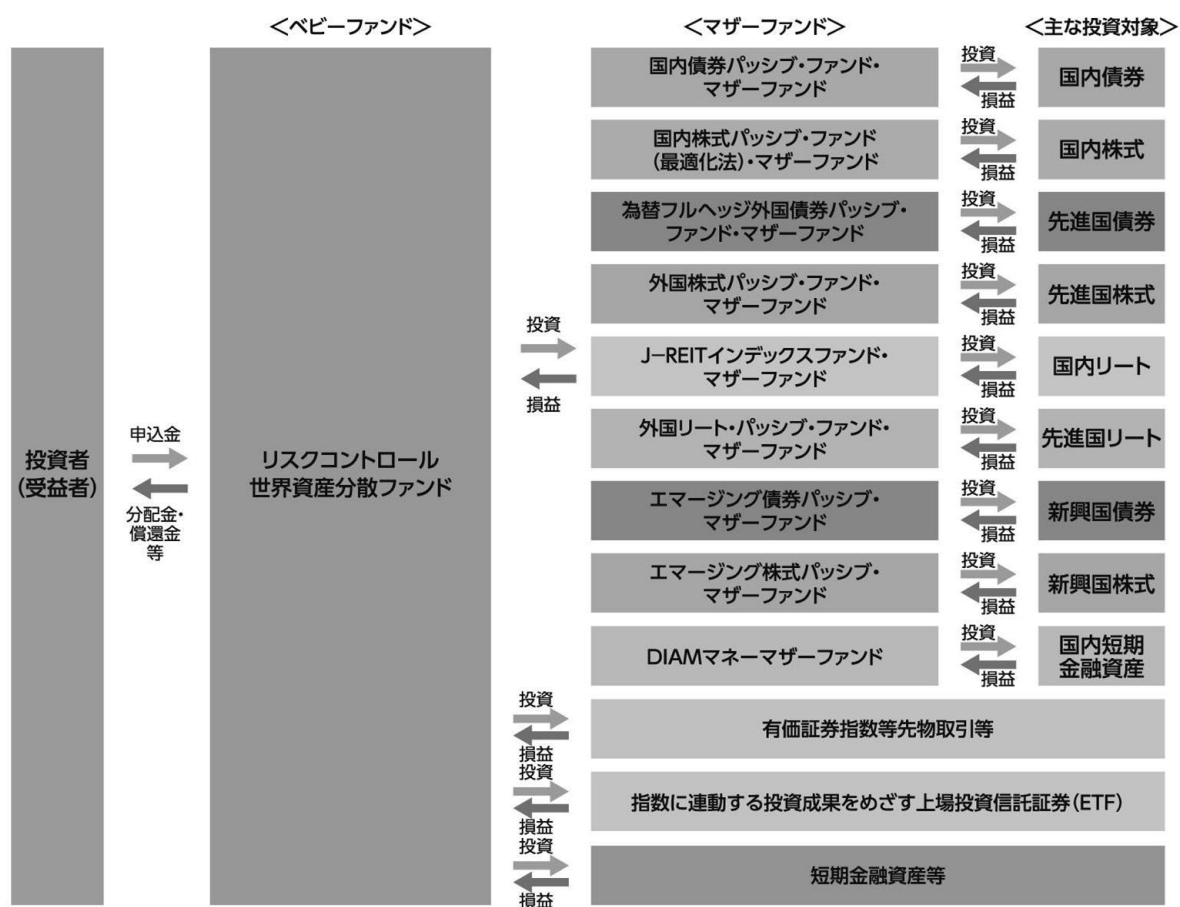
委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U. S. A. ・インク）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を各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11月30日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日

会社設立

1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A M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	D I A M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11月30日現在)

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

※1：A種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

<投資対象>

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

<投資態度>

①以下のマザーファンド受益証券、有価証券指数等先物取引、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（E T F）等への投資を通じて、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（以下「各資産」ということがあります。）に実質的に分散投資を行います。

- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・J－R E I T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
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド

（上記マザーファンドおよびD I A Mマネーマザーファンドを以下「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

上記のほか、D I A Mマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

②各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。その後各資産のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度※¹となるよう最終的に基本配分比率を決定します※²。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜見直しを行うことがあります。

※¹ 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は基本資産配分に基づくポートフォリオの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

※² 実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

③基準価額の下落を一定水準（下値目安値^(*)）までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去1年間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

(**) 合計資産比率とは、「D I A Mマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびE T F等への投資比率の合計をいいます。

④ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

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。

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24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）

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

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親投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・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、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、DIAMマネーマザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を含む次の有価証券（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. 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。）

8. 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。）

9. 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。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 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
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.～11.の証券または証書の性質を有するもの
 13. 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ます。）
 14. 投資証券、新投資口予約権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、15.で定めるものを除きます。）
 15. 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ます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 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、12.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6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

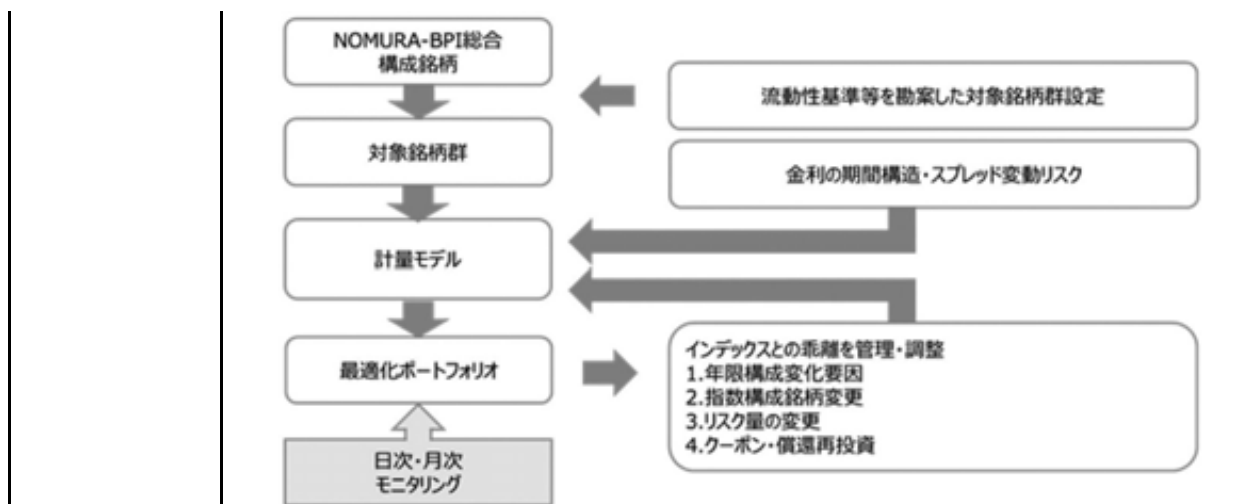
③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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の指図をすることができます。

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

(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA-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;"> <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</p> <p>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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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>国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>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。</p>
<p>投資態度</p>	<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>

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。

- ※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。
- 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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。

運用プロセス

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

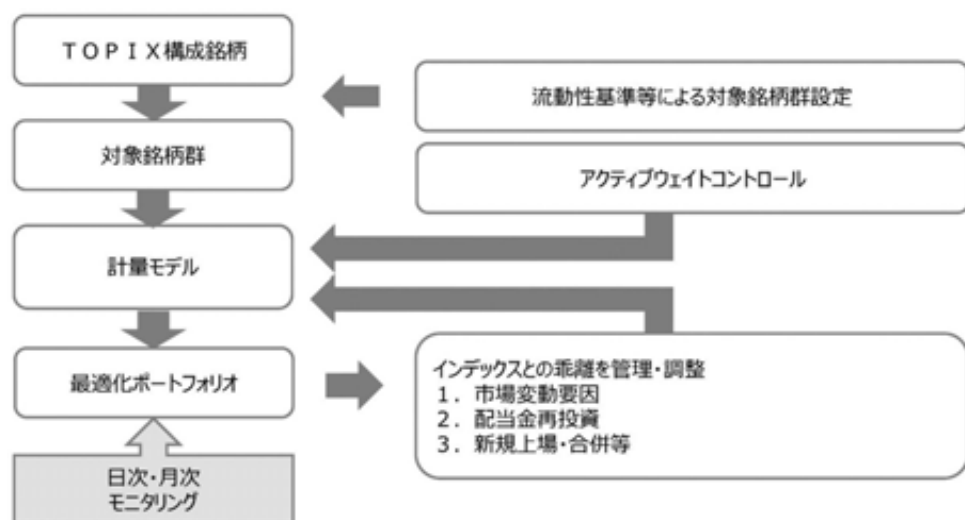
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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。

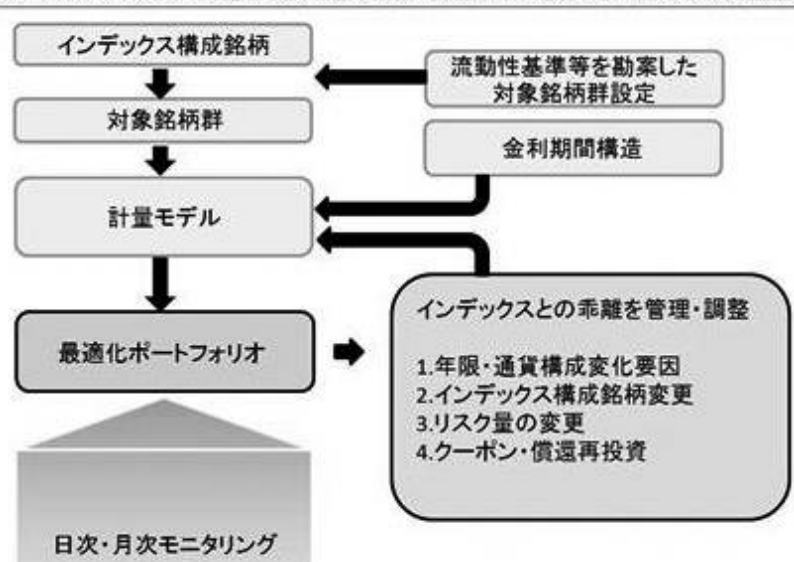
- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定



主な投資制限

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。

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。

<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、為替ヘッジあり）」※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. 外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>
<p>運用プロセス</p>	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1.年限・通貨構成変化要因] H2[2.インデックス構成銘柄変更] H3[3.リスク量の変更] H4[4.クーポン・償還再投資] end </pre>
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

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

ディングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

1. 流動性基準による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

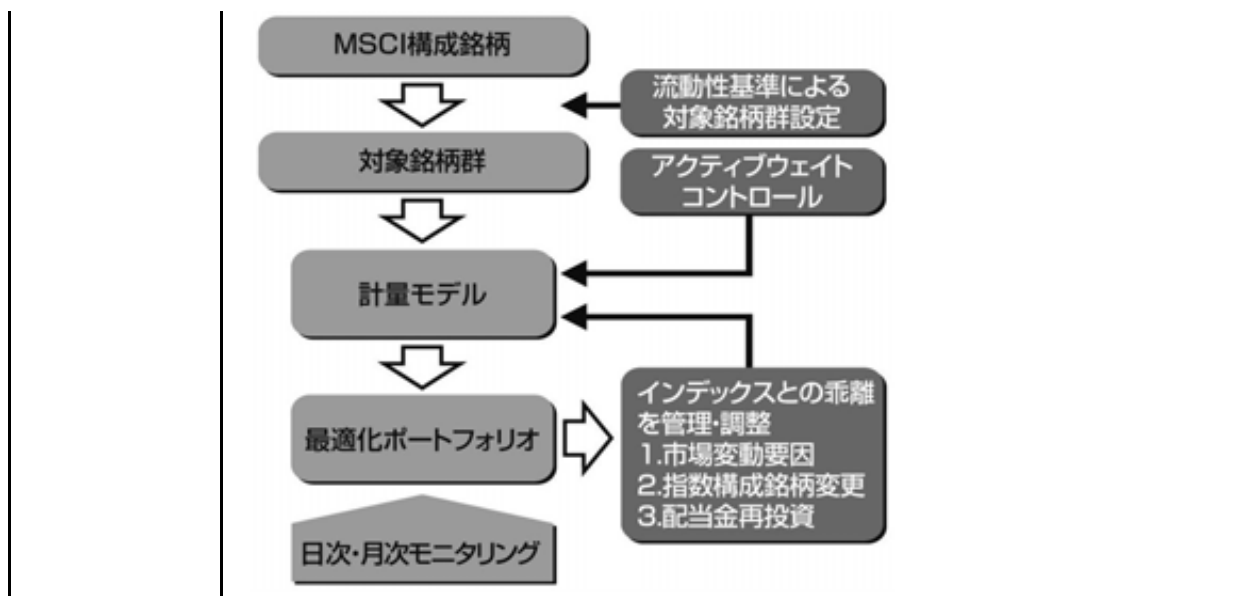
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

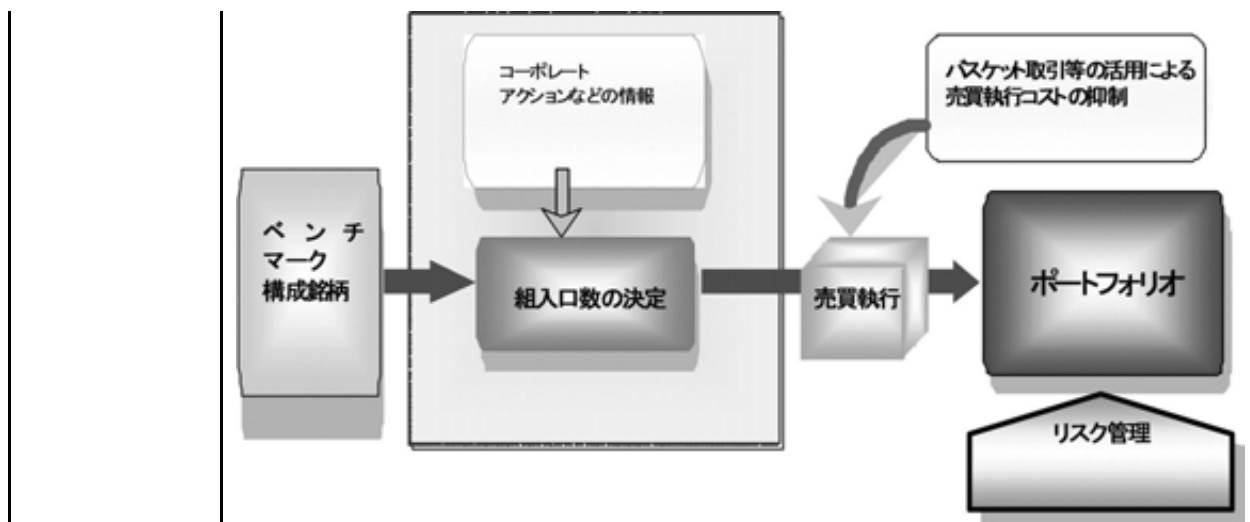
<p>ファンド名</p>	<p>J-REITインデックスファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数[※]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います。

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。
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。

- ※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。
- 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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。

運用プロセス

- ・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。
- ・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。
- ・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>	<p>①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>③株式への投資は行いません。</p> <p>④外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>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>
---------------	--

<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>	<p>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</p>

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。

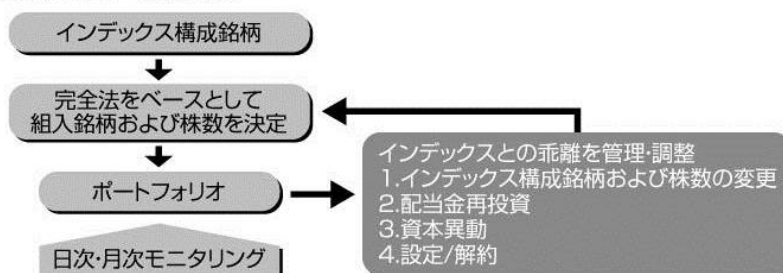
2. 不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。

※ 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。

	<p>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--	---

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、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めざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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めざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>3. 組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはM o o d y ' s の外貨建て長期格付がB B - 格もしくはB a 3 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。</p> <p>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。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>※ 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・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ . P . モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日々・月次モニタリング] E --> F[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] F --> C G[信用格付基準等を勘案した 対象銘柄群設定] --> B H[金利期間構造] --> C </pre>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>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。</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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	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書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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。</p> <p>2. 原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</p> <p>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> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <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限りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いま</p> </div>

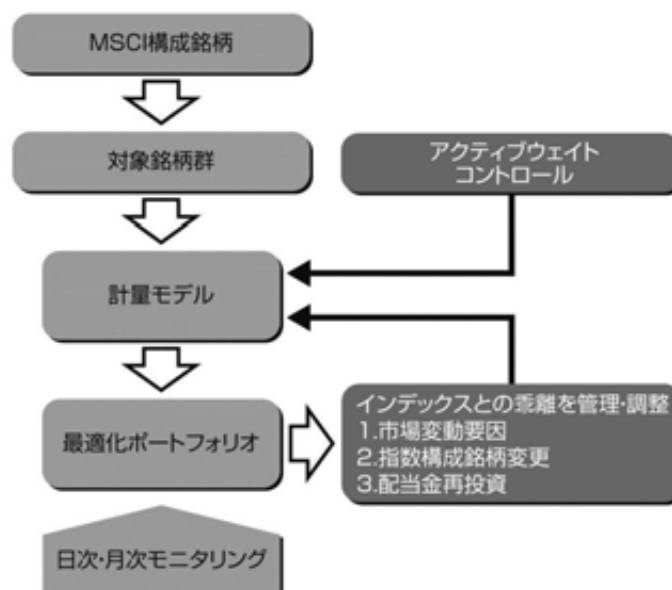
せん。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

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。
 日々・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。



主な投資制限

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. 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。

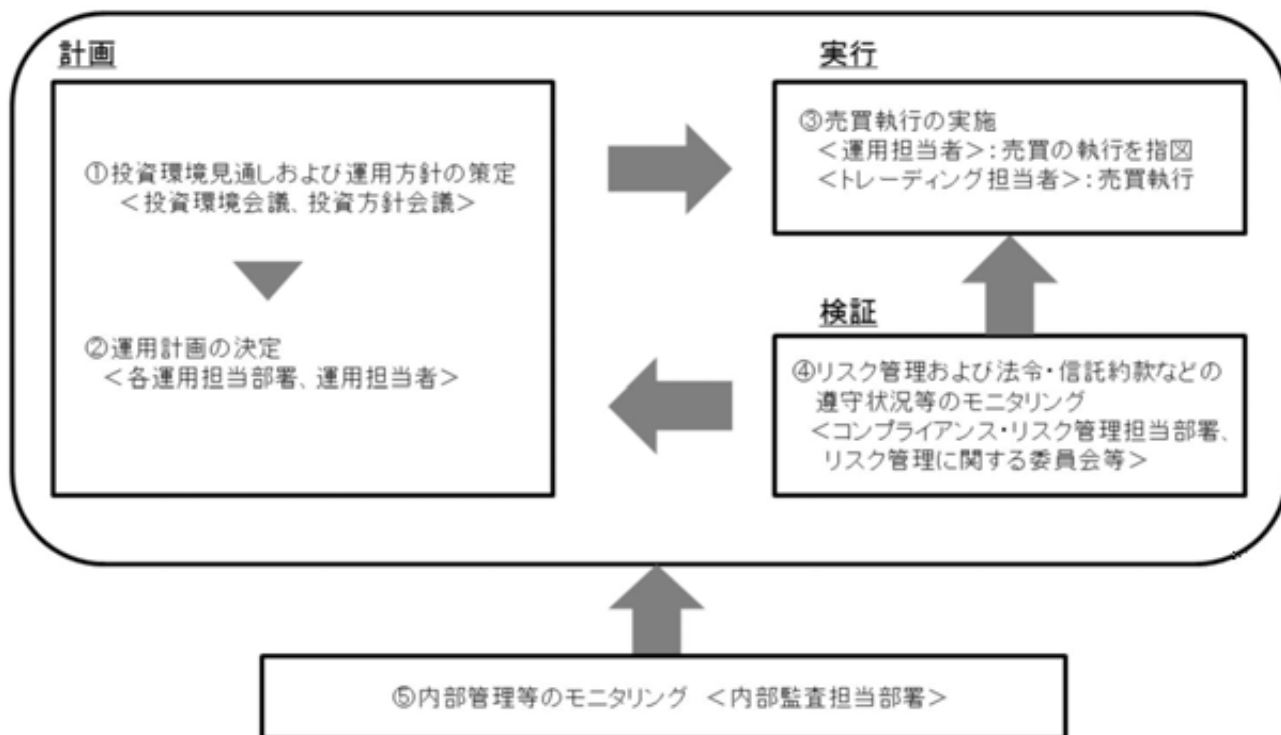
ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（*）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さ

	<p>らに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*) 主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody's、S&Pとします。</p> <p>②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	<p>マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します(トップダウンアプローチ)。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑤投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑥外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>⑦デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>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>

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。

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

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11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年11月11日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（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。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、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) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

②収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬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、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、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

(2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

①各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

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

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

④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）

⑤同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

⑥デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

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。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

⑧投資する株式等の範囲（約款第20条）

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

⑨信用取引の指図範囲（約款第23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（上記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

⑩先物取引等の運用指図（約款第24条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑩で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑩で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
 - 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑩で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ⑪スワップ取引の運用指図（約款第25条）
- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交

換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
 - 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 - 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 - 6) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。
- ⑫金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第26条）
- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
 - 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 - 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額

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

- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産（「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 - 6) 上記5)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 - 7) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 - 8) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。
- ⑬デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第27条）
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑭有価証券の貸付の指図および範囲（約款第28条）
- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1. 2. の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - 2) 上記1) 1. 2. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

- ⑮公社債の空売りの指図および範囲（約款第29条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債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、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引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)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑯公社債の借入れの指図および範囲（約款第30条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑰特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第31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。

⑱外国為替予約取引の指図（約款第32条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとしま

す。

⑱資金の借入れ（約款第38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。

⑳同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

○資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、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。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。当ファンドは、公社債、株式およびリートに資産配分を行いますが、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には、基準価額が下落する要因となります。

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

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や当ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

金利の変動は、公社債等の価格に影響をおよぼします。金利変動は、公社債・株式・リート等の各資産への投資の相対的魅力度を変化させるため、金利変動により各資産の市場の間で資金移動が起こる場合があります、基準価額を下落させる要因となる可能性があります。

○不動産投資信託証券（リート）の価格変動リスク

リー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、関係法令・規制等の変更等の影響を受けます。また、老朽化・災害等の発生による保有不動産の滅失・損壊等が発生する可能性があります。当ファンドが実質的に投資するリーートの市場価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない資産については、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。

為替ヘッジを行う資産については、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、当ファンドは投資環境によっては、為替予約取引の売建を実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があるため、為替相場の影響を受けます。なお、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

○信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当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、基準価額が下落する要因となります。

○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。

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、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要因となります。

○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・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。当ファンドが実質的に投資を行う株式・債券や通貨の発行者が属する新興国の経済状況は、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等が株式・債券市場や為替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、海外への送金規制等の種々な規制の導入や政策の変更等の要因も株式・債券市場や為替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>

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドは、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がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。
 - ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
 - ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。
 - ・分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。
- 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、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。
- 当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。
- 当ファンドは過去1年間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整[※]します。そのため、基準価額は、長期的に10%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

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

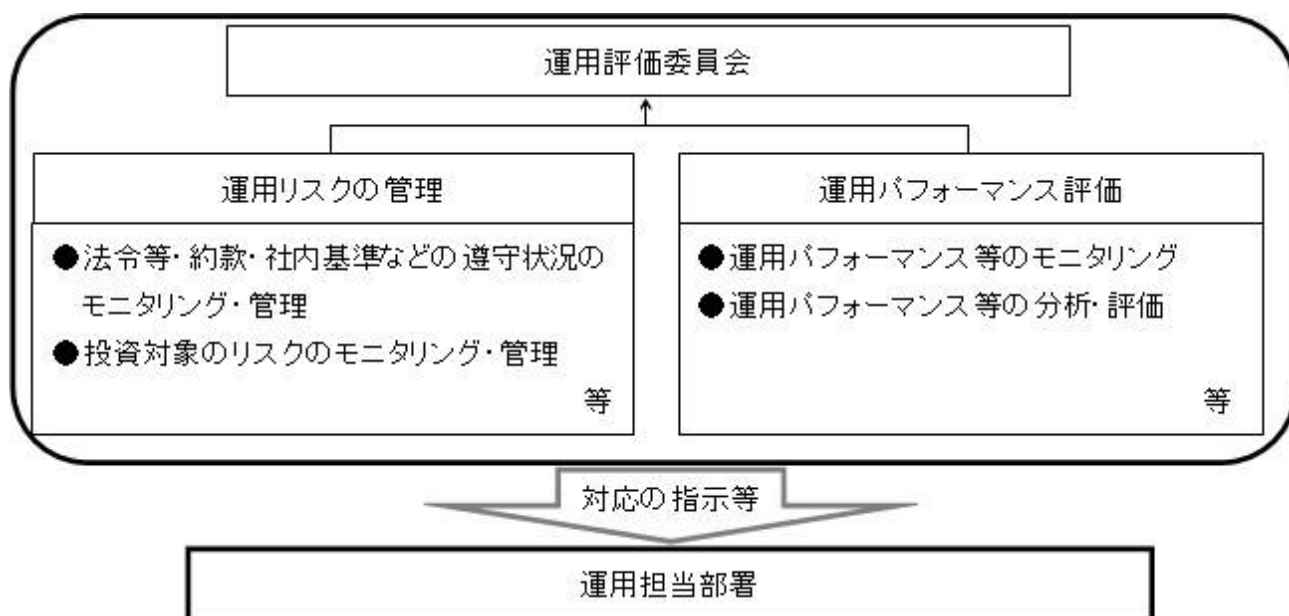
○注意事項

- ・当ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券（リート）など値動きのある有価証券（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、基準価額は変動します。
- ・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。
- ・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。
- ・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。

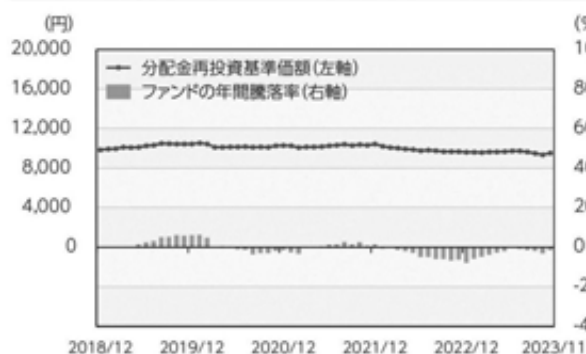


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

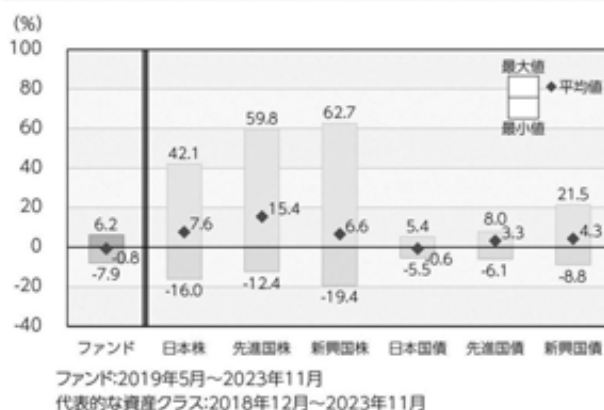
※リスク管理体制は2023年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村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】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に1.1% (税抜1.0%) を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.089% (税抜0.99%)

支払先	内訳 (税抜)	主な役務
委託会社	年率0.48%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.48%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

※信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の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。

※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・イंक)に対する投資顧問報酬(当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.216%)が含まれます。

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

・信託財産留保額
ありません。

・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、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、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および外国での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および外国での資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

※上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

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。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象となります。当ファンドは、NISAの対象ではありません。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、2024年1月1日現在のものです。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は販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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 …

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
1.11%	1.09%	0.02%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年11月12日~2023年11月13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、当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】

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	35,339,259,726	67.35
内 日本	35,339,259,726	67.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,132,213,301	32.65
純資産総額	52,471,473,027	100.00

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

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

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	463,206,715,650	84.38
内 日本	463,206,715,650	84.38
地方債証券	29,994,713,181	5.46
内 日本	29,994,713,181	5.46
特殊債券	28,798,875,797	5.25
内 日本	28,798,875,797	5.25
社債券	23,616,291,600	4.30
内 日本	23,223,209,600	4.23
内 フランス	393,082,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,351,948,676	0.61
純資産総額	548,968,544,904	100.00

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

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	471,970,053,700	97.67
内 日本	471,970,053,700	97.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,252,681,532	2.33
純資産総額	483,222,735,232	100.00

その他資産の投資状況

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	11,381,040,000	2.36
内 日本	11,381,040,000	2.36

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）

国債証券		256,654,701,471	98.20
内 アメリカ		122,331,133,262	46.81
内 フランス		21,788,924,074	8.34
内 イタリア		19,443,258,145	7.44
内 中国		18,009,826,152	6.89
内 ドイツ		16,746,494,769	6.41
内 イギリス		13,062,170,675	5.00
内 スペイン		12,874,949,591	4.93
内 カナダ		5,105,577,283	1.95
内 ベルギー		4,556,206,629	1.74
内 オランダ		3,872,624,751	1.48
内 オーストラリア		3,786,812,047	1.45
内 オーストリア		3,052,695,765	1.17
内 メキシコ		2,323,322,898	0.89
内 アイルランド		1,496,517,195	0.57
内 フィンランド		1,322,470,144	0.51
内 ポーランド		1,318,923,728	0.50
内 マレーシア		1,286,180,202	0.49
内 シンガポール		1,107,603,871	0.42
内 デンマーク		812,628,112	0.31
内 イスラエル		788,459,718	0.30
内 ニュージーランド		596,632,706	0.23
内 スウェーデン		528,544,070	0.20
内 ノルウェー		442,745,684	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,692,079,188	1.80
純資産総額		261,346,780,659	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11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	1,153,040,458,823	96.54
内 アメリカ	826,704,621,104	69.22
内 イギリス	46,692,548,512	3.91
内 カナダ	39,850,797,142	3.34
内 スイス	37,348,801,352	3.13
内 フランス	37,247,766,065	3.12
内 ドイツ	28,883,347,750	2.42
内 オランダ	22,581,968,058	1.89
内 オーストラリア	22,174,302,963	1.86
内 アイルランド	21,650,247,741	1.81
内 デンマーク	11,387,327,300	0.95
内 スウェーデン	10,184,900,509	0.85
内 スペイン	9,143,536,236	0.77
内 イタリア	6,530,053,523	0.55
内 香港	5,606,203,563	0.47
内 ジャージー	3,857,987,749	0.32
内 シンガポール	3,673,841,974	0.31
内 フィンランド	3,657,587,915	0.31

	内 ベルギー	2,618,378,424	0.22
	内 ノルウェー	2,278,357,265	0.19
	内 イスラエル	2,236,495,715	0.19
	内 バミューダ	1,748,933,729	0.15
	内 オランダ領キュラソー	1,618,856,048	0.14
	内 ケイマン諸島	1,527,304,814	0.13
	内 ニュージーランド	850,117,207	0.07
	内 ルクセンブルグ	683,919,408	0.06
	内 ポルトガル	649,072,638	0.05
	内 オーストリア	641,227,507	0.05
	内 リベリア	541,615,059	0.05
	内 パナマ	325,431,095	0.03
	内 マン島	144,910,458	0.01
新株予約権証券		0	0.00
	内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		1,876,666,869	0.16
	内 オーストラリア	1,378,255,268	0.12
	内 シンガポール	498,411,601	0.04
投資証券		21,701,674,531	1.82
	内 アメリカ	20,366,911,449	1.71
	内 フランス	485,153,245	0.04
	内 イギリス	395,558,812	0.03
	内 香港	300,564,173	0.03
	内 ベルギー	83,036,477	0.01
	内 カナダ	70,450,375	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		17,731,377,175	1.48
純資産総額		1,194,350,177,398	100.00

その他資産の投資状況

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	18,654,166,882	1.56
内 アメリカ	14,148,159,737	1.18
内 ドイツ	2,722,921,316	0.23
内 イギリス	792,723,817	0.07
内 カナダ	629,470,555	0.05
内 オーストラリア	360,891,457	0.03

(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11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	94,159,875,457	97.67
内 サウジアラビア	11,015,769,011	11.43
内 メキシコ	9,474,448,215	9.83
内 アラブ首長国連邦	8,038,721,332	8.34
内 カタール	7,199,234,157	7.47

内 ブラジル	6,876,709,782	7.13
内 チリ	6,625,408,728	6.87
内 ドミニカ共和国	6,335,549,045	6.57
内 コロンビア	5,752,674,771	5.97
内 ハンガリー	5,653,888,360	5.86
内 南アフリカ	4,610,690,825	4.78
内 パナマ	4,603,828,216	4.78
内 インドネシア	3,890,239,312	4.04
内 ルーマニア	3,534,236,081	3.67
内 ペルー	3,521,034,512	3.65
内 オマーン	2,538,073,172	2.63
内 フィリピン	2,425,255,527	2.52
内 ウルグアイ	1,143,871,668	1.19
内 中国	920,242,743	0.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,244,064,757	2.33
純資産総額	96,403,940,214	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11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	82,972,343,099	92.99
内 ケイマン諸島	13,789,705,862	15.45
内 インド	13,245,390,775	14.84
内 台湾	12,962,242,139	14.53
内 韓国	10,630,956,552	11.91
内 中国	8,879,750,655	9.95
内 ブラジル	4,541,869,286	5.09
内 サウジアラビア	3,383,448,101	3.79
内 南アフリカ	2,408,102,502	2.70
内 インドネシア	1,581,451,687	1.77
内 メキシコ	1,563,637,739	1.75
内 タイ	1,496,588,895	1.68
内 マレーシア	1,147,661,291	1.29
内 アラブ首長国連邦	1,089,652,644	1.22
内 香港	789,615,545	0.88
内 カタール	741,673,659	0.83
内 ポーランド	739,750,342	0.83
内 クエート	641,686,079	0.72
内 トルコ	577,516,670	0.65
内 フィリピン	520,626,218	0.58
内 ギリシャ	421,104,923	0.47
内 チリ	409,378,582	0.46
内 バミューダ	347,411,162	0.39
内 アメリカ	303,959,501	0.34
内 ハンガリー	211,046,962	0.24
内 チェコ	137,841,784	0.15
内 イギリス	103,693,810	0.12
内 ルクセンブルグ	82,369,453	0.09

	内 コロンビア	82,253,662	0.09
	内 エジプト	50,973,843	0.06
	内 オランダ	46,617,019	0.05
	内 ペルー	25,354,784	0.03
	内 シンガポール	19,010,973	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		708,927,714	0.79
	内 メキシコ	505,147,334	0.57
	内 ブラジル	203,780,380	0.23
投資証券		80,176,933	0.09
	内 メキシコ	54,712,724	0.06
	内 南アフリカ	25,464,209	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,467,826,350	6.13
純資産総額		89,229,274,096	100.00

その他資産の投資状況

2023年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,475,857,310	6.14
内 アメリカ	5,475,857,310	6.14

（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。

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	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	9,407,896,230	1.2237 11,513,125,285	1.2385 11,651,679,480	— —	22.21
2	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	9,255,527,968	1.1434 10,583,049,734	1.1625 10,759,551,262	— —	20.51
3	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	735,857,134	7.4786 5,503,217,086	7.5211 5,534,455,090	— —	10.55
4	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	823,477,337	4.0806 3,360,313,684	4.1378 3,407,384,525	— —	6.49
5	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	1,552,326,459	1.5390 2,389,170,720	1.5432 2,395,550,191	— —	4.57

6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	715,988,107	2.2137	2.2216	—	3.03
				1,585,033,969	1,590,639,178	—	

(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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	67.35
合計	67.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	6,900,000,000	100.14 6,909,867,000	100.17 6,911,799,000	0.1 2025/9/20	1.26
2	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,860,000,000	99.34 5,821,850,000	99.59 5,836,267,000	0.1 2028/3/20	1.06
3	449回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	5,600,000,000	99.96 5,598,040,000	100.00 5,600,392,000	0.005 2025/6/1	1.02
4	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,520,000,000	98.48 5,436,539,000	98.63 5,444,652,000	0.1 2029/12/20	0.99
5	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	97.85 5,381,816,000	97.94 5,387,140,000	0.1 2030/9/20	0.98
6	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,410,000,000	99.46 5,381,104,000	99.57 5,387,007,500	0.005 2027/6/20	0.98
7	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,450,000,000	96.78 5,275,041,000	96.85 5,278,325,000	0.1 2031/9/20	0.96
8	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,330,000,000	98.60 5,255,605,000	98.93 5,273,235,500	0.1 2029/6/20	0.96
9	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,430,000,000	96.39 5,234,201,000	96.60 5,245,597,200	0.1 2031/12/20	0.96
10	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,200,000,000	100.22 5,211,927,000	100.15 5,207,956,000	0.1 2025/12/20	0.95

11	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,190,000,000	99.23 5,150,467,000	99.45 5,161,922,100	0.1 2028/6/20	0.94
12	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,300,000,000	96.94 5,138,031,000	96.94 5,137,979,000	0.2 2032/6/20	0.94
13	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,150,000,000	99.38 5,118,505,000	99.71 5,135,477,000	0.1 2027/12/20	0.94
14	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,170,000,000	97.29 5,030,104,000	97.16 5,023,172,000	0.1 2031/6/20	0.92
15	154回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	5,000,000,000	99.50 4,975,420,000	99.82 4,991,450,000	0.1 2027/9/20	0.91
16	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,020,000,000	99.57 4,998,472,000	99.01 4,970,452,600	0.5 2032/12/20	0.91
17	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,000,000,000	99.57 4,978,672,000	98.81 4,940,700,000	0.5 2033/3/20	0.90
18	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,080,000,000	97.11 4,933,282,000	97.18 4,936,896,400	0.2 2032/3/20	0.90
19	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,890,000,000	100.15 4,897,774,000	100.04 4,892,200,500	0.1 2026/12/20	0.89
20	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	5,050,000,000	97.52 4,925,051,000	96.65 4,881,077,500	0.2 2032/9/20	0.89
21	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,950,000,000	97.90 4,846,400,000	98.21 4,861,395,000	0.1 2030/6/20	0.89
22	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,840,000,000	100.07 4,843,484,000	99.98 4,839,177,200	0.1 2027/3/20	0.88
23	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,900,000,000	97.41 4,773,149,000	97.67 4,786,026,000	0.1 2030/12/20	0.87
24	453回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証 券	4,700,000,000	99.84 4,692,668,000	99.96 4,698,261,000	0.005 2025/10/1	0.86
25	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,700,000,000	99.67 4,684,776,000	99.91 4,695,817,000	0.1 2027/6/20	0.86
26	371回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,800,000,000	96.95 4,653,830,000	97.70 4,689,936,000	0.4 2033/6/20	0.85
27	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,810,000,000	97.20 4,675,454,000	97.42 4,686,046,300	0.1 2031/3/20	0.85

28	150回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	4,570,000,000	99.57	99.75	0.005	0.83
				4,550,696,000	4,558,849,200	2026/12/20	
29	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	4,530,000,000	100.32	100.17	0.1	0.83
				4,544,681,000	4,537,701,000	2025/6/20	
30	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,450,000,000	99.13	99.28	0.1	0.80
				4,411,573,000	4,418,316,000	2028/9/20	

(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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.38
地方債証券	5.46
特殊債券	5.25
社債券	4.30
合計	99.39

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	7,680,800	2,015.48 15,480,535,736	2,794.50 21,463,995,600	— —	4.44
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	989,500	12,154.75 12,027,131,364	12,820.00 12,685,390,000	— —	2.63
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,627,900	979.49 8,450,986,115	1,255.00 10,828,014,500	— —	2.24
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	139,900	60,676.65 8,488,664,718	63,350.00 8,862,665,000	— —	1.83
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	41,729,400	157.79 6,584,629,394	173.10 7,223,359,140	— —	1.49
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	296,000	16,461.19 4,872,514,392	24,025.00 7,111,400,000	— —	1.47
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	979,500	5,857.14 5,737,074,620	7,258.00 7,109,211,000	— —	1.47
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	679,000	7,408.87 5,030,623,684	10,285.00 6,983,515,000	— —	1.45
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	977,500	5,154.63 5,038,658,896	6,886.00 6,731,065,000	— —	1.39

10	信越化学工業	日本	株式 化学	1,270,600	4,024.86 5,113,993,769	5,212.00 6,622,367,200	— —	1.37
11	任天堂	日本	株式 その他製品	883,100	5,699.18 5,032,949,935	6,912.00 6,103,987,200	— —	1.26
12	三井物産	日本	株式 卸売業	1,115,100	4,258.93 4,749,142,843	5,392.00 6,012,619,200	— —	1.24
13	リクルートホールディングス	日本	株式 サービス業	1,064,600	4,348.38 4,629,288,599	5,505.00 5,860,623,000	— —	1.21
14	伊藤忠商事	日本	株式 卸売業	994,900	4,398.01 4,375,585,195	5,738.00 5,708,736,200	— —	1.18
15	武田薬品工業	日本	株式 医薬品	1,241,600	4,228.63 5,250,277,258	4,165.00 5,171,264,000	— —	1.07
16	本田技研工業	日本	株式 輸送用機器	3,411,100	1,180.54 4,026,943,271	1,509.00 5,147,349,900	— —	1.07
17	KDDI	日本	株式 情報・通信業	1,084,100	4,058.59 4,399,918,314	4,625.00 5,013,962,500	— —	1.04
18	東京海上ホールディングス	日本	株式 保険業	1,361,800	2,819.55 3,839,673,691	3,648.00 4,967,846,400	— —	1.03
19	第一三共	日本	株式 医薬品	1,222,200	4,127.45 5,044,577,070	4,000.00 4,888,800,000	— —	1.01
20	みずほフィナンシャルグループ	日本	株式 銀行業	1,859,600	2,135.68 3,971,521,989	2,512.00 4,671,315,200	— —	0.97
21	HOYA	日本	株式 精密機器	277,900	14,445.37 4,014,369,302	16,665.00 4,631,203,500	— —	0.96
22	ソフトバンクグループ	日本	株式 情報・通信業	692,000	6,207.88 4,295,855,920	6,020.00 4,165,840,000	— —	0.86
23	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	2,256,900	1,552.89 3,504,739,095	1,798.50 4,059,034,650	— —	0.84
24	オリエンタルランド	日本	株式 サービス業	761,000	4,440.58 3,379,284,552	5,025.00 3,824,025,000	— —	0.79
25	ダイキン工業	日本	株式 機械	168,700	23,053.33 3,889,098,120	22,155.00 3,737,548,500	— —	0.77
26	村田製作所	日本	株式 電気機器	1,272,600	2,596.50 3,304,310,481	2,883.50 3,669,542,100	— —	0.76
27	日本たばこ産業	日本	株式 食料品	836,900	2,780.59 2,327,077,060	3,801.00 3,181,056,900	— —	0.66
28	三菱電機	日本	株式 電気機器	1,572,400	1,572.80 2,473,072,232	2,009.00 3,158,951,600	— —	0.65
29	SMC	日本	株式 機械	42,300	68,754.56 2,908,317,954	74,450.00 3,149,235,000	— —	0.65
30	丸紅	日本	株式 卸売業	1,233,900	1,858.48 2,293,184,180	2,307.00 2,846,607,300	— —	0.59

(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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	97.67
合計	97.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年11月30日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	16.90
輸送用機器		8.47
情報・通信業		7.50
銀行業		7.01
卸売業		6.86
化学		5.84
機械		5.09
サービス業		4.70
医薬品		4.65
小売業		4.18
食料品		3.35
陸運業		2.71
保険業		2.39
精密機器		2.28
その他製品		2.24
建設業		2.03
不動産業		1.91
電気・ガス業		1.35
その他金融業		1.13
鉄鋼		0.96
証券、商品先物取引業		0.77
海運業		0.74
ゴム製品		0.71
非鉄金属		0.67
ガラス・土石製品		0.66
金属製品		0.51
石油・石炭製品		0.47
空運業		0.44
繊維製品		0.41
鉱業		0.36
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業	0.14	
水産・農林業	0.08	
合計	97.67	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

--	--	--	--	--	--

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	1,940,557,680	102.05 1,980,402,087	101.53 1,970,257,527	3.03 2026/3/11	0.75
2	US T N/B 2.875 11/30/25 アメリカ	国債証券	1,638,359,800	96.25 1,576,960,507	96.65 1,583,577,144	2.875 2025/11/30	0.61
3	US T N/B 4.5 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,500,114,000	99.37 1,490,762,701	99.71 1,495,807,037	4.5 2025/11/15	0.57
4	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,441,286,000	94.90 1,367,834,094	96.81 1,395,345,008	3.875 2033/8/15	0.53
5	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,514,821,000	83.72 1,268,211,523	83.35 1,262,626,964	1.625 2031/5/15	0.48
6	US T N/B 4.25 10/15/25 アメリカ	国債証券	1,230,975,900	99.01 1,218,860,405	99.20 1,221,190,600	4.25 2025/10/15	0.47
7	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,500,114,000	80.75 1,211,358,526	80.39 1,205,980,316	1.25 2031/8/15	0.46
8	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,220,681,000	99.72 1,217,331,921	98.77 1,205,708,590	4.125 2032/11/15	0.46
9	US T N/B 5.0 10/31/25 アメリカ	国債証券	1,176,560,000	100.30 1,180,195,570	100.57 1,183,270,062	5 2025/10/31	0.45
10	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,308,923,000	89.88 1,176,473,669	90.04 1,178,567,565	2.875 2032/5/15	0.45
11	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,469,229,300	80.29 1,179,776,026	79.93 1,174,379,087	0.875 2030/11/15	0.45
12	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,441,286,000	80.74 1,163,820,796	80.62 1,162,008,688	1.375 2031/11/15	0.44
13	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25 中国	国債証券	1,143,322,200	101.53 1,160,851,698	101.30 1,158,275,596	3.02 2025/10/22	0.44
14	CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32 中国	国債証券	1,133,022,000	100.56 1,139,376,152	100.64 1,140,374,406	2.76 2032/5/15	0.44
15	US T N/B 0.375 12/31/25 アメリカ	国債証券	1,235,388,000	91.04 1,124,760,769	91.74 1,133,347,841	0.375 2025/12/31	0.43
16	FRANCE OAT 6.0 10/25/25 フランス	国債証券	1,044,969,700	105.89 1,106,560,327	105.58 1,103,372,011	6 2025/10/25	0.42
17	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,250,095,000	83.91 1,048,994,341	83.48 1,043,658,410	1.875 2032/2/15	0.40
18	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50 中国	国債証券	896,117,400	113.87 1,020,440,525	113.92 1,020,894,489	3.81 2050/9/14	0.39
19	US T N/B 3.375 11/15/48 アメリカ	国債証券	1,242,741,500	84.42 1,049,158,479	81.71 1,015,455,736	3.375 2048/11/15	0.39
20	CHINA GOVERNMENT BOND 2.46 02/15/26 中国	国債証券	1,009,419,600	100.53 1,014,857,549	99.98 1,009,257,759	2.46 2026/2/15	0.39
21	CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28 中国	国債証券	968,218,800	99.46 963,015,736	99.28 961,307,770	2.4 2028/7/15	0.37

22	FRANCE OAT 1.0 11/25/25 フランス	国債証 券	985,211,000	95.65 942,434,107	96.35 949,293,162	1 2025/11/25	0.36
23	US T N/B 4.0 02/15/26 アメリカ	国債証 券	955,955,000	98.50 941,706,123	98.80 944,528,355	4 2026/2/15	0.36
24	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証 券	1,029,490,000	90.61 932,845,890	91.40 940,977,991	0.375 2026/1/31	0.36
25	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	1,189,796,300	78.62 935,521,050	78.86 938,335,633	0.625 2030/8/15	0.36
26	US T N/B 4.625 02/28/25 アメリカ	国債証 券	926,541,000	99.56 922,541,668	99.53 922,215,933	4.625 2025/2/28	0.35
27	US T N/B 4.375 08/15/26 アメリカ	国債証 券	911,834,000	99.36 906,020,322	99.80 910,017,453	4.375 2026/8/15	0.35
28	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証 券	875,517,000	100.13 876,715,119	100.00 875,524,616	2.68 2030/5/21	0.34
29	US T N/B 2.25 03/31/26 アメリカ	国債証 券	882,420,000	94.46 833,611,879	95.02 838,488,579	2.25 2026/3/31	0.32
30	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	904,456,000	90.49 818,458,030	91.51 827,716,526	1.5 2031/5/25	0.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.20
合計	98.20

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,331,541	23,510.37 54,815,405,749	27,850.64 64,934,922,792	— —	5.44
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,047,225	42,186.50 44,178,762,791	55,717.46 58,348,726,997	— —	4.89
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,369,189	15,760.04 21,578,486,353	21,519.28 29,463,964,749	— —	2.47
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	366,286	41,700.77 15,274,410,246	70,799.49 25,932,864,924	— —	2.17

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	881,185	15,290.79 13,474,019,844	19,852.97 17,494,147,564	— —	1.46
6	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	328,040	30,913.70 10,140,932,289	48,856.65 16,026,936,778	— —	1.34
7	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	783,554	15,212.78 11,920,039,939	20,060.34 15,718,365,916	— —	1.32
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	423,117	31,510.77 13,332,744,535	35,905.66 15,192,299,288	— —	1.27
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	137,987	73,178.27 10,097,650,301	78,679.50 10,856,749,353	— —	0.91
10	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	119,666	58,182.16 6,962,426,993	87,044.85 10,416,309,044	— —	0.87
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	191,620	46,745.31 8,957,336,933	52,752.53 10,108,441,389	— —	0.85
12	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	432,533	20,987.62 9,077,841,742	22,695.84 9,816,700,800	— —	0.82
13	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	65,729	100,696.46 6,618,677,659	138,367.86 9,094,781,602	— —	0.76
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	239,625	33,966.36 8,139,190,905	37,389.60 8,959,484,361	— —	0.75
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	593,892	16,833.49 9,997,277,164	15,051.14 8,938,753,893	— —	0.75
16	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	356,591	23,631.13 8,426,651,443	22,370.81 7,977,232,254	— —	0.67
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式	348,735	20,901.47	22,226.68	—	0.65

	アメリカ	家庭用品		7,289,077,388	7,751,224,423	—	
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	125,305	54,994.39 6,891,072,962	60,272.22 7,552,411,454	— —	0.63
19	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	484,214	11,640.74 5,636,610,726	14,932.40 7,230,479,070	— —	0.61
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	148,947	45,870.05 6,832,206,940	45,741.71 6,813,090,687	— —	0.57
21	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	395,086	18,440.53 7,285,597,789	16,709.35 6,601,631,360	— —	0.55
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	67,635	60,635.22 4,101,063,390	90,799.54 6,141,227,381	— —	0.51
23	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	59,922	99,255.17 5,947,568,806	101,622.09 6,089,398,996	— —	0.51
24	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	269,029	24,796.43 6,670,960,216	21,164.84 5,693,956,735	— —	0.48
25	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	65,588	75,535.57 4,954,227,367	86,456.57 5,670,513,526	— —	0.47
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	375,951	15,887.20 5,972,808,959	14,873.18 5,591,590,315	— —	0.47
27	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	261,732	22,280.49 5,831,518,820	20,369.19 5,331,270,145	— —	0.45
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	607,988	8,709.46 5,295,248,649	8,563.88 5,206,739,982	— —	0.44
29	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	219,021	21,896.48 4,795,791,118	22,954.68 5,027,558,194	— —	0.42
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	203,773	25,693.34 5,235,610,742	24,584.22 5,009,600,506	— —	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	96.54
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.82
合計	98.52

(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11月30日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
ソフトウェア	外国	8.89
半導体・半導体製造装置		6.29
コンピュータ・周辺機器		5.70
銀行		5.23
医薬品		4.93
石油・ガス・消耗燃料		4.58
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.26
保険		3.14
資本市場		3.13
金融サービス		3.08
大規模小売り		2.90
ヘルスケア機器・用品		2.16
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.13
ホテル・レストラン・レジャー		2.04
自動車		1.89
化学		1.87
機械		1.77
バイオテクノロジー		1.76
航空宇宙・防衛		1.70
生活必需品流通・小売り		1.66
電力		1.63
飲料		1.57
専門小売り		1.56
金属・鉱業		1.46
食品		1.45
情報技術サービス		1.39
繊維・アパレル・贅沢品		1.23
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.15
家庭用品		1.07
陸上運輸		1.05
娯楽		1.02
専門サービス		1.00
各種電気通信サービス		0.97
コングロマリット		0.90
電気設備		0.86
総合公益事業		0.76
メディア		0.66
通信機器		0.66
パーソナルケア用品		0.61
建設関連製品		0.60
商業サービス・用品		0.57
タバコ		0.56
航空貨物・物流サービス		0.50
電子装置・機器・部品		0.50
商社・流通業		0.42
消費者金融		0.35

不動産管理・開発	0.33
建設・土木	0.32
家庭用耐久財	0.31
建設資材	0.30
エネルギー設備・サービス	0.27
無線通信サービス	0.22
容器・包装	0.22
自動車用部品	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12
運送インフラ	0.10
ガス	0.10
紙製品・林産品	0.10
水道	0.10
販売	0.08
海上運輸	0.05
旅客航空輸送	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.01
合計	96.54

(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11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	2,058,980,000	103.66 2,134,453,382	103.98 2,141,030,353	7.125 2033/1/17	2.22
2	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	2,353,120,000	88.07 2,072,569,268	89.19 2,098,799,496	4.817 2049/3/14	2.18
3	BRAZIL 3.75 09/12/31 ブラジル	国債証券	2,206,050,000	85.51 1,886,497,457	87.69 1,934,507,967	3.75 2031/9/12	2.01
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	1,911,910,000	97.81 1,870,093,586	97.57 1,865,557,653	4.375 2029/4/16	1.94
5	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,911,910,000	95.23 1,820,841,314	96.93 1,853,367,315	4 2029/3/14	1.92
6	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証券	1,941,324,000	87.53 1,699,258,545	89.82 1,743,840,874	3.25 2030/10/22	1.81
7	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,764,840,000	94.49 1,667,644,366	94.69 1,671,155,286	5.5 2029/2/22	1.73
8	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,764,840,000	86.62 1,528,804,415	90.11 1,590,334,385	4.85 2029/9/30	1.65
9	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	1,911,910,000	68.30	73.07	5.75	1.45

	南アフリカ			1,305,897,770	1,397,189,413	2049/9/30	
10	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証 券	1,764,840,000	74.44 1,313,785,134	77.37 1,365,557,303	2.125 2031/9/22	1.42
11	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証 券	1,323,630,000	100.93 1,335,945,641	101.62 1,345,072,806	6.25 2032/9/22	1.40
12	PANAMA 3.16 01/23/30 パナマ	国債証 券	1,617,770,000	84.17 1,361,745,043	82.33 1,331,973,311	3.16 2030/1/23	1.38
13	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証 券	1,617,770,000	77.28 1,250,342,665	80.56 1,303,323,608	3 2034/1/15	1.35
14	DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49 ドミニカ共和国	国債証 券	1,470,700,000	81.99 1,205,951,939	88.22 1,297,522,780	6.4 2049/6/5	1.35
15	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33 サウジアラビア	国債証 券	1,617,770,000	77.16 1,248,271,332	79.49 1,286,054,350	2.25 2033/2/2	1.33
16	INDONESIA 3.85 10/15/30 インドネシア	国債証 券	1,382,458,000	90.72 1,254,195,311	93.00 1,285,686,035	3.85 2030/10/15	1.33
17	ROMANIA 4.0 02/14/51 ルーマニア	国債証 券	1,911,910,000	68.07 1,301,576,118	66.58 1,273,007,035	4 2051/2/14	1.32
18	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証 券	1,323,630,000	95.75 1,267,485,895	96.10 1,272,009,144	2.875 2025/6/6	1.32
19	COLOMBIA 3.25 04/22/32 コロンビア	国債証 券	1,617,770,000	72.50 1,173,044,521	75.71 1,224,910,797	3.25 2032/4/22	1.27
20	COLOMBIA 7.5 02/02/34 コロンビア	国債証 券	1,176,560,000	95.89 1,128,319,395	100.33 1,180,503,887	7.5 2034/2/2	1.22
21	REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41 チリ	国債証 券	1,617,770,000	69.55 1,125,177,006	71.93 1,163,756,244	3.1 2041/5/7	1.21
22	BRAZIL 6.0 10/20/33 ブラジル	国債証 券	1,176,560,000	95.44 1,122,952,985	97.95 1,152,503,524	6 2033/10/20	1.20
23	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証 券	1,323,630,000	85.13 1,126,858,575	86.79 1,148,838,040	7.3 2052/4/20	1.19
24	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証 券	1,176,560,000	96.35 1,133,684,977	97.25 1,144,244,603	2.125 2024/9/30	1.19
25	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証 券	1,176,560,000	96.41 1,134,382,677	97.22 1,143,871,668	4.375 2031/1/23	1.19
26	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証 券	1,176,560,000	96.41 1,134,421,503	96.35 1,133,660,269	2.5 2025/4/16	1.18
27	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証 券	1,176,560,000	93.76 1,103,227,956	94.98 1,117,508,453	3.75 2030/4/16	1.16
28	ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31 アラブ首長国連邦	国債証 券	1,323,630,000	79.64 1,054,234,527	81.98 1,085,167,466	1.875 2031/9/15	1.13
29	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証 券	1,029,490,000	99.76 1,027,019,224	102.94 1,059,793,038	5.5 2032/10/25	1.10
30	OMAN GOV INTERNTL BOND	国債証	1,029,490,000	98.01	101.61	6	1.09

6.0	08/01/29	オマーン	券		1,009,070,801	1,046,070,965	2029/8/1
-----	----------	------	---	--	---------------	---------------	----------

(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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.67
合計	97.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,081,866	2,494.30 5,192,813,913	2,704.45 5,630,319,991	— —	6.31
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	566,800	6,761.32 3,832,318,593	5,972.28 3,385,088,304	— —	3.79
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	403,642	7,587.00 3,062,432,409	8,295.06 3,348,238,644	— —	3.75
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,388,968	1,722.70 2,392,787,754	1,369.66 1,902,425,022	— —	2.13
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	257,162	3,839.09 987,269,650	4,273.24 1,098,916,487	— —	1.23
6	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	50,641	11,114.78 562,864,058	20,844.23 1,055,572,707	— —	1.18
7	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラ ン・レ ジャー	429,610	2,484.67 1,067,440,618	1,704.07 732,088,949	— —	0.82
8	INFOSYS LTD	株式	281,161	2,275.21	2,598.08	—	0.82

	インド	情報技術 サービス		639,701,499	730,481,020	—	
9	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	435,384	1,621.98 706,187,928	1,672.48 728,174,515	— —	0.82
10	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	46,198	10,818.46 499,791,488	14,878.63 687,363,410	— —	0.77
11	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,117,530	98.56 800,109,623	84.40 685,145,508	— —	0.77
12	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	234,638	2,881.61 676,135,860	2,775.28 651,187,791	— —	0.73
13	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉄 業	289,089	2,267.51 655,514,216	2,200.57 636,162,514	— —	0.71
14	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	128,747	3,379.20 435,062,486	4,466.59 575,060,938	— —	0.64
15	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	164,400	2,813.95 462,614,921	3,330.91 547,601,932	— —	0.61
16	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,050,367	489.72 514,395,939	480.58 504,788,734	— —	0.57
17	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	165,180	2,969.16 490,446,866	2,972.73 491,037,028	— —	0.55
18	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	77,213	5,655.68 436,692,035	6,254.47 482,926,778	— —	0.54
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	68,941	6,428.78 443,206,649	6,594.97 454,664,516	— —	0.51
20	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小 売り	16,610	26,079.07 433,173,439	26,922.59 447,184,311	— —	0.50
21	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	400,612	824.76 330,409,012	1,055.49 422,845,103	— —	0.47
22	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	191,500	2,437.88 466,855,517	2,168.48 415,264,686	— —	0.47

23	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	199,935	2,693.19 538,463,109	2,008.34 401,538,257	— —	0.45
24	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	4,675,300	86.72 405,467,193	85.44 399,457,632	— —	0.45
25	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,507,235	78.42 431,903,882	70.08 385,973,463	— —	0.43
26	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	569,000	984.55 560,212,859	673.53 383,238,570	— —	0.43
27	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	408,547	792.12 323,619,716	932.06 380,791,061	— —	0.43
28	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,301,600	240.07 312,482,640	291.64 379,602,789	— —	0.43
29	AXIS BANK LTD インド	株式 銀行	192,806	1,585.48 305,691,030	1,887.06 363,837,840	— —	0.41
30	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	318,110	929.87 295,803,745	1,119.01 355,969,374	— —	0.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	92.99
投資信託受益証券	0.79
投資証券	0.09
合計	93.87

(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11月30日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
銀行	外国	15.57
半導体・半導体製造装置		9.27
コンピュータ・周辺機器		6.00
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.13
石油・ガス・消耗燃料		4.75
大規模小売り		4.64
金属・鉱業		3.57
自動車		2.91
化学		2.67
保険		2.46
電子装置・機器・部品		2.43
情報技術サービス		2.11
ホテル・レストラン・レジャー		1.96

食品	1.57
不動産管理・開発	1.44
生活必需品流通・小売り	1.44
無線通信サービス	1.38
電気設備	1.30
医薬品	1.26
各種電気通信サービス	1.23
飲料	1.20
コングロマリット	1.20
娯楽	1.09
金融サービス	1.05
電力	1.02
資本市場	0.91
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.91
繊維・アパレル・贅沢品	0.86
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.86
バイオテクノロジー	0.70
専門小売り	0.69
建設資材	0.69
パーソナルケア用品	0.68
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.66
建設・土木	0.65
機械	0.63
自動車用部品	0.63
消費者金融	0.62
運送インフラ	0.62
ガス	0.34
タバコ	0.34
家庭用耐久財	0.34
陸上運輸	0.33
旅客航空輸送	0.32
航空宇宙・防衛	0.31
航空貨物・物流サービス	0.28
各種消費者サービス	0.27
海上運輸	0.26
ソフトウェア	0.25
通信機器	0.23
紙製品・林産品	0.19
ヘルスケア機器・用品	0.14
商社・流通業	0.13
水道	0.11
家庭用品	0.08
メディア	0.07
エネルギー設備・サービス	0.06
建設関連製品	0.05
商業サービス・用品	0.05
総合公益事業	0.05
容器・包装	0.02
レジャー用品	0.02
合計	92.99

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0512月	買建	479	11,051,593,070	11,381,040,000	2.36

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec23	買建	422	13,540,131,913	14,148,159,737	1.18
	EUREX	DJ EURO STOXX 50	買建	385	2,603,823,842	2,722,921,316	0.23

取引所	Dec23						
I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec23	買建	57	796,461,552	792,723,817	0.07	
モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec23	買建	24	610,535,969	629,470,555	0.05	
シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Dec23	買建	21	355,570,687	360,891,457	0.03	

(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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Dec23	買建	756	5,336,195,961	5,475,857,310	6.14

(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。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

直近日（2023年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第1計算期間末 (2018年11月12日)	16,055	16,055	0.9834	0.9834
第2計算期間末 (2019年11月11日)	63,143	63,143	1.0389	1.0389
第3計算期間末 (2020年11月11日)	116,766	116,766	1.0188	1.0188
第4計算期間末 (2021年11月11日)	83,658	83,658	1.0436	1.0436
第5計算期間末 (2022年11月11日)	63,428	63,428	0.9668	0.9668
第6計算期間末 (2023年11月13日)	52,793	52,793	0.9454	0.9454
2022年11月末日	62,892	—	0.9664	—
12月末日	61,552	—	0.9605	—
2023年1月末日	60,886	—	0.9608	—
2月末日	59,986	—	0.9594	—
3月末日	59,254	—	0.9633	—
4月末日	58,634	—	0.9649	—
5月末日	58,421	—	0.9677	—

6月末日	58,333	—	0.9739	—
7月末日	57,880	—	0.9735	—
8月末日	56,271	—	0.9637	—
9月末日	54,771	—	0.9492	—
10月末日	52,987	—	0.9357	—
11月末日	52,471	—	0.9518	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	△1.7
第2計算期間	5.6
第3計算期間	△1.9
第4計算期間	2.4
第5計算期間	△7.4
第6計算期間	△2.2

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	17,241,080,294	914,894,367
第2計算期間	48,308,726,995	3,853,963,676
第3計算期間	84,183,367,871	30,357,847,700
第4計算期間	5,948,816,817	40,393,734,727
第5計算期間	3,490,938,507	18,046,893,924
第6計算期間	2,335,400,156	12,097,868,661

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

基準価額・純資産の推移 (2018年5月25日~2023年11月30日)



分配の推移 (税引前)

2019年11月	0円
2020年11月	0円
2021年11月	0円
2022年11月	0円
2023年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
 (設定日:2018年5月25日)

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	22.21
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	20.51
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	10.55
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	6.49
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	4.57
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	3.03

■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	145回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.26
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.06
3	449回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2025/6/1	1.02
4	357回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2029/12/20	0.99
5	360回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2030/9/20	0.98

○掲載データ等はい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。

■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	4.44
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.63
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.24
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.83
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.49

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	中国	3.03	2026/3/11	0.75
2	US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	アメリカ	2.875	2025/11/30	0.61
3	US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	アメリカ	4.5	2025/11/15	0.57
4	US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	アメリカ	3.875	2033/8/15	0.53
5	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.48

■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	5.44
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.89
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.47
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.17
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	1.46

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	ルーマニア	7.125	2033/1/17	2.22
2	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	2.18
3	BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	ブラジル	3.75	2031/9/12	2.01
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	1.94
5	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国債証券	カタール	4	2029/3/14	1.92

○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。

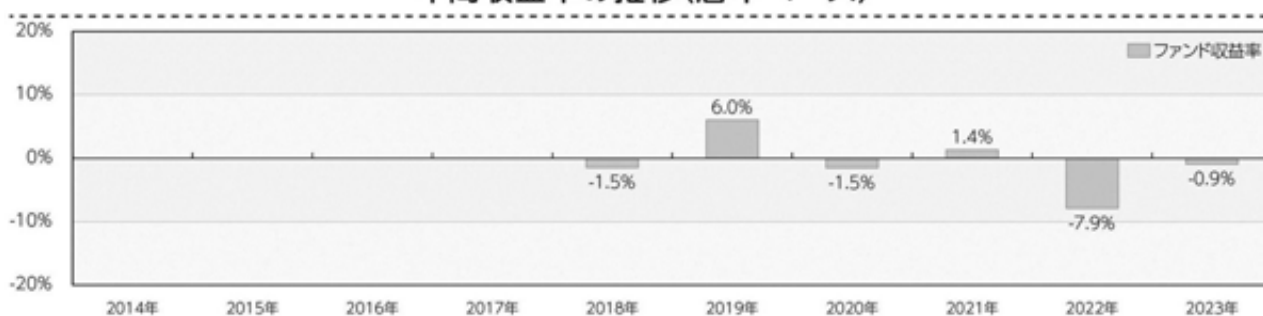
■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	6.31
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	3.79
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.75
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.13
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.23

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。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および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。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

<基準価額の照会方法等>

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <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）

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入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
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
株式	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
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。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <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、2018年5月25日（設定日）から原則として2028年5月11日までです。

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

(4) 【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年11月12日から翌年11月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

イ. 償還規定

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

任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託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、信託約款は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、信託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、信託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、この投資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信託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。

また、投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S. A.・インク）の間の当該契約は、原則として期間満了の90日前までにいずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドの信託終了まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

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11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

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

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

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

なお、「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。

再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(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、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】

- (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6期計算期間（2022年11月12日から2023年11月13日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年1月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの2022年11月12日から2023年11月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの2023年11月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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】

【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2022年11月11日現在	第6期 2023年11月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	29,917,956,186	22,311,158,871
国債証券	21,009,720,000	—
親投資信託受益証券	12,892,638,217	31,012,910,478
派生商品評価勘定	39,996,081	317,460
流動資産合計	63,860,310,484	53,324,386,809
資産合計	63,860,310,484	53,324,386,809
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	83,119,717
未払解約金	61,938,279	133,439,272
未払受託者報酬	11,172,378	9,510,511
未払委託者報酬	357,517,366	304,337,686
その他未払費用	860,218	763,757
流動負債合計	431,488,241	531,170,943
負債合計	431,488,241	531,170,943
純資産の部		
元本等		
元本	65,605,596,090	55,843,127,585
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△2,176,773,847	△3,049,911,719
(分配準備積立金)	1,137,584,148	1,042,162,119
元本等合計	63,428,822,243	52,793,215,866
純資産合計	63,428,822,243	52,793,215,866
負債純資産合計	63,860,310,484	53,324,386,809

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2021年11月12日	自	2022年11月12日
	至	2022年11月11日	至	2023年11月13日
営業収益				
受取利息		159,544		99,768
有価証券売買等損益		△4,326,886,894		927,382,626
為替差損益		△520,494,354		△1,538,854,100
営業収益合計		△4,847,221,704		△611,371,706
営業費用				
支払利息		6,767,163		5,700,571
受託者報酬		23,744,823		19,448,712
委託者報酬		759,836,692		622,361,869
その他費用		3,635,311		3,635,460
営業費用合計		793,983,989		651,146,612
営業利益又は営業損失(△)		△5,641,205,693		△1,262,518,318
経常利益又は経常損失(△)		△5,641,205,693		△1,262,518,318
当期純利益又は当期純損失(△)		△5,641,205,693		△1,262,518,318
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(△)		△741,440,575		△74,879,770
期首剰余金又は期首欠損金(△)		3,496,932,267		△2,176,773,847
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,088,850		402,086,366
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		—		402,086,366
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,088,850		—
剰余金減少額又は欠損金増加額		775,029,846		87,585,690
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		775,029,846		—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		—		87,585,690
分配金		—		—
期末剰余金又は期末欠損金(△)		△2,176,773,847		△3,049,911,719

(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6期	
	自 2022年11月12日	至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年11月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2023年11月13日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期
	2022年11月11日現在	2023年11月13日現在
1. 期首元本額	80,161,551,507円	65,605,596,090円
期中追加設定元本額	3,490,938,507円	2,335,400,156円
期中一部解約元本額	18,046,893,924円	12,097,868,661円
2. 受益権の総数	65,605,596,090口	55,843,127,585口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,176,773,847円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,049,911,719円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期	第6期
	自 2021年11月12日 至 2022年11月11日	自 2022年11月12日 至 2023年11月13日
1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（842,379,917円）及び分配準備積立金（1,137,584,148円）より分配対象収益は1,979,964,065円（1万口当たり301.79円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（110,220,050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（754,401,487円）及び分配準備積立金（931,942,069円）より分配対象収益は1,796,563,606円（1万口当たり321.71円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第5期	第6期
	自 2021年11月12日 至 2022年11月11日	自 2022年11月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期
	2022年11月11日現在	2023年11月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しており	同左

<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>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。 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つた場合、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>	<p>同左</p>
-----------------------------------	---	-----------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第5期 2022年11月11日現在	第6期 2023年11月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	△7,668,000	—
親投資信託受益証券	△513,643,969	354,324,394
合計	△521,311,969	354,324,394

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第5期 2022年11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 売建	1,732,188,345	—	1,692,192,264	39,996,081
イギリス・ポンド	718,483,696	—	697,007,694	21,476,002
オーストラリア・ドル	290,552,508	—	285,764,526	4,787,982
カナダ・ドル	144,761,323	—	141,039,584	3,721,739
ユーロ	578,390,818	—	568,380,460	10,010,358
合計	1,732,188,345	—	1,692,192,264	39,996,081

種類	第6期 2023年11月13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	7,993,112,963	—	8,075,915,220	△82,802,257
イギリス・ポンド	3,065,399,673	—	3,095,031,500	△29,631,827
オーストラリア・ドル	1,017,664,452	—	1,024,020,920	△6,356,468
カナダ・ドル	850,014,682	—	857,259,720	△7,245,038
ユーロ	3,060,034,156	—	3,099,603,080	△39,568,924
合計	7,993,112,963	—	8,075,915,220	△82,802,257

(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)

	第5期 2022年11月11日現在	第6期 2023年11月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9668円 (9,668円)	0.9454円 (9,454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11月13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	732,155,870	2,980,313,684	
	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	8,361,106,801	10,223,125,285	
	外国株式パッシブ・ファン	654,569,192	4,883,217,086	

	ド・マザーファンド			
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,228,334,852	9,400,049,734	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,380,275,460	2,118,170,720	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	636,543,386	1,408,033,969	
親投資信託受益証券	合計	19,992,985,561	31,012,910,478	
	合計		31,012,910,478	

(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

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,665,496,322
国債証券	449,504,516,150
地方債証券	30,128,100,157
特殊債券	28,490,256,333
社債券	24,085,713,490
未収利息	747,916,452
前払費用	131,040,825
流動資産合計	535,753,039,729
資産合計	535,753,039,729
負債の部	
流動負債	
未払解約金	57,305,000
流動負債合計	57,305,000
負債合計	57,305,000
純資産の部	
元本等	
元本	438,127,800,594
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	97,567,934,135
元本等合計	535,695,734,729
純資産合計	535,695,734,729
負債純資産合計	535,753,039,729

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11月12日 至 2023年11月13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11月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	613, 180, 832, 594円
同期中追加設定元本額	825, 578, 591, 494円
同期中一部解約元本額	1, 000, 631, 623, 494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	26, 201, 968, 544円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	56, 117, 188円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	86, 648, 665円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	48, 477, 463円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	783, 327, 260円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	265, 357, 375円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	41, 090, 742円
たわらノーロード 国内債券	19, 038, 306, 097円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5, 192, 909, 666円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1, 486, 976, 826円
たわらノーロード バランス（標準型）	2, 805, 413, 335円
たわらノーロード バランス（積極型）	368, 455, 838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）	168, 118, 163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, 237, 975, 244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, 381, 238, 179円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	667, 172, 497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）	30, 649, 326円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	22, 029, 341円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	187, 166, 586円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	5, 495, 533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, 680, 413, 350円
O n eグローバルバランス	74, 500, 940円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	10, 586, 168, 424円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	15, 587, 210, 751円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	6, 862, 150, 763円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2, 571, 332, 885円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2, 644, 433, 665円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	495, 917, 205円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	75, 882, 531円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2, 859, 473, 215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）	5, 140, 138, 301円

D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,247,433,102円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	455,345,604円
投資のソムリエ	96,651,426,491円
クルーズコントロール	945,604,294円
投資のソムリエ<DC年金>	8,804,068,176円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,131,863,789円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,920,674,179円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,734,321,911円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	33,843,657,307円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	494,182,919円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	247,534,442円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	79,014,285円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,038,037,307円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,276,553,626円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,361,106,801円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,992,311,336円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	537,115,716円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	270,727,411円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	164,115,791円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,913,974,412円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	39,354,556円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	142,397,182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)	1,167,534,651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)	1,172,032,430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)	1,552,681,806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)	706,532,898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)	1,152,339,265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)	2,980,757,352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)	1,960,125,052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)	1,035,526,887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)	2,008,043,556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)	10,273,768,642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)	2,880,153,489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)	594,422,164円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	260,244,071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）	1,927,959,684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）	45,030,010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）	150,198,795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）	90,081,664円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	20,867,630円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	59,158,293円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	29,282,601円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	360,180円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	7,872,702円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	93,474,044円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2,734,334,213円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,098,490,683円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,216,507,763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）	54,190,575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）	129,518,890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）	1,597,146,325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）	101,779,246円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	548,116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）	1,605,453,024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）	32,051,842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）	264,839,337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）	465,519,383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）	798,935,275円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	203,070,561円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	95,507,648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>	252,040,406円
コア資産形成ファンド	148,890,039円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	18,384,500,862円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	29,908,755,893円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	18,532,995,722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]	448,028,025円
計	438,127,800,594円
2. 受益権の総数	438,127,800,594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11月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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11月13日現在
	当期の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△10,582,602,150
地方債証券	△314,266,007
特殊債券	△445,225,351
社債券	△210,492,790
合計	△11,552,586,298

(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（2023年2月15日から2023年11月13日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年11月13日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2227円 (12,227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11月13日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 4 4回 利付国庫債券 (2年)	2,700,000,000	2,701,053,000	
	4 4 5回 利付国庫債券 (2年)	2,400,000,000	2,400,720,000	
	4 4 6回 利付国庫債券 (2年)	1,900,000,000	1,900,361,000	
	4 4 7回 利付国庫債券 (2年)	2,600,000,000	2,600,338,000	
	4 4 8回 利付国庫債券 (2年)	2,000,000,000	2,000,140,000	
	4 4 9回 利付国庫債券 (2年)	5,600,000,000	5,599,552,000	
	4 5 0回 利付国庫債券 (2年)	2,200,000,000	2,199,450,000	
	4 5 2回 利付国庫債券 (2年)	500,000,000	499,550,000	
	4 5 3回 利付国庫債券 (2年)	4,700,000,000	4,693,373,000	
	1 4 2回 利付国庫債券 (5年)	2,930,000,000	2,934,482,900	
	1 4 3回 利付国庫債券 (5年)	3,700,000,000	3,705,439,000	
	1 4 4回 利付国庫債券 (5年)	4,530,000,000	4,536,477,900	
	1 4 5回 利付国庫債券 (5年)	6,900,000,000	6,906,348,000	
	1 4 6回 利付国庫債券 (5年)	5,200,000,000	5,202,132,000	
	1 4 7回 利付国庫債券 (5年)	3,250,000,000	3,242,005,000	
	1 4 8回 利付国庫債券 (5年)	4,210,000,000	4,195,812,300	
	1 4 9回 利付国庫債券 (5年)	2,380,000,000	2,369,528,000	
	1 5 0回 利付国庫債券 (5年)	4,570,000,000	4,543,951,000	
	1 5 1回 利付国庫債券 (5年)	1,900,000,000	1,886,111,000	
	1 5 2回 利付国庫債券 (5年)	1,890,000,000	1,882,137,600	

年)			
1 5 3回 利付国庫債券 (5年)	5,410,000,000	5,360,823,100	
1 5 4回 利付国庫債券 (5年)	5,000,000,000	4,963,800,000	
1 5 5回 利付国庫債券 (5年)	1,800,000,000	1,798,542,000	
1 5 6回 利付国庫債券 (5年)	3,600,000,000	3,582,504,000	
1 5 7回 利付国庫債券 (5年)	1,900,000,000	1,887,384,000	
1 5 8回 利付国庫債券 (5年)	3,600,000,000	3,560,688,000	
1 5 9回 利付国庫債券 (5年)	2,100,000,000	2,072,952,000	
1 6 0回 利付国庫債券 (5年)	900,000,000	892,476,000	
1 6 1回 利付国庫債券 (5年)	1,000,000,000	995,930,000	
1 6 2回 利付国庫債券 (5年)	1,000,000,000	994,060,000	
1回 利付国庫債券 (40年)	110,000,000	125,747,600	
2回 利付国庫債券 (40年)	330,000,000	363,082,500	
3回 利付国庫債券 (40年)	540,000,000	592,903,800	
4回 利付国庫債券 (40年)	720,000,000	790,149,600	
5回 利付国庫債券 (40年)	710,000,000	748,588,500	
6回 利付国庫債券 (40年)	940,000,000	969,215,200	
7回 利付国庫債券 (40年)	1,080,000,000	1,061,920,800	
8回 利付国庫債券 (40年)	1,190,000,000	1,082,673,900	
9回 利付国庫債券 (40年)	2,090,000,000	1,384,290,600	
10回 利付国庫債券 (40年)	1,830,000,000	1,425,881,100	
11回 利付国庫債券 (40年)	1,240,000,000	926,664,400	
12回 利付国庫債券 (40年)	1,520,000,000	1,008,200,800	
13回 利付国庫債券 (40年)	2,090,000,000	1,371,019,100	
14回 利付国庫債券 (40年)	2,000,000,000	1,403,660,000	
15回 利付国庫債券 (40年)	2,240,000,000	1,731,318,400	

16回 利付国庫債券（40年）	900,000,000	762,120,000	
338回 利付国庫債券（10年）	3,230,000,000	3,247,797,300	
339回 利付国庫債券（10年）	3,980,000,000	4,004,755,600	
340回 利付国庫債券（10年）	3,300,000,000	3,321,318,000	
341回 利付国庫債券（10年）	3,620,000,000	3,636,652,000	
342回 利付国庫債券（10年）	3,520,000,000	3,519,155,200	
343回 利付国庫債券（10年）	4,090,000,000	4,086,278,100	
344回 利付国庫債券（10年）	3,570,000,000	3,563,895,300	
345回 利付国庫債券（10年）	4,890,000,000	4,876,405,800	
346回 利付国庫債券（10年）	4,840,000,000	4,819,865,600	
347回 利付国庫債券（10年）	4,700,000,000	4,673,163,000	
348回 利付国庫債券（10年）	4,070,000,000	4,040,533,200	
349回 利付国庫債券（10年）	5,150,000,000	5,104,113,500	
350回 利付国庫債券（10年）	5,860,000,000	5,796,008,800	
351回 利付国庫債券（10年）	5,190,000,000	5,123,152,800	
352回 利付国庫債券（10年）	4,450,000,000	4,382,315,500	
353回 利付国庫債券（10年）	3,690,000,000	3,627,417,600	
354回 利付国庫債券（10年）	4,260,000,000	4,179,954,600	
355回 利付国庫債券（10年）	5,330,000,000	5,219,562,400	
356回 利付国庫債券（10年）	3,700,000,000	3,614,826,000	
357回 利付国庫債券（10年）	4,220,000,000	4,112,769,800	
358回 利付国庫債券（10年）	4,450,000,000	4,325,889,500	
359回 利付国庫債券（10年）	4,950,000,000	4,799,025,000	
360回 利付国庫債券（10年）	5,300,000,000	5,122,238,000	
361回 利付国庫債券（10年）	4,800,000,000	4,623,984,000	
362回 利付国庫債券（10年）	4,810,000,000	4,616,445,600	

0年)			
3 6 3回 利付国庫債券 (10年)	4,170,000,000	3,988,062,900	
3 6 4回 利付国庫債券 (10年)	5,450,000,000	5,193,141,500	
3 6 5回 利付国庫債券 (10年)	5,430,000,000	5,156,545,200	
3 6 6回 利付国庫債券 (10年)	5,080,000,000	4,849,114,000	
3 6 7回 利付国庫債券 (10年)	5,300,000,000	5,044,169,000	
3 6 8回 利付国庫債券 (10年)	5,050,000,000	4,791,642,000	
3 6 9回 利付国庫債券 (10年)	5,020,000,000	4,879,841,600	
3 7 0回 利付国庫債券 (10年)	5,000,000,000	4,848,450,000	
3 7 1回 利付国庫債券 (10年)	4,800,000,000	4,602,192,000	
3 7 2回 利付国庫債券 (10年)	1,600,000,000	1,589,824,000	
1回 利付国庫債券 (30年)	110,000,000	124,555,200	
2回 利付国庫債券 (30年)	100,000,000	111,446,000	
4回 利付国庫債券 (30年)	200,000,000	231,204,000	
6回 利付国庫債券 (30年)	200,000,000	225,892,000	
1 1回 利付国庫債券 (30年)	250,000,000	269,572,500	
1 2回 利付国庫債券 (30年)	230,000,000	256,712,200	
1 3回 利付国庫債券 (30年)	150,000,000	166,119,000	
1 4回 利付国庫債券 (30年)	340,000,000	389,925,600	
1 5回 利付国庫債券 (30年)	260,000,000	301,119,000	
1 6回 利付国庫債券 (30年)	240,000,000	278,229,600	
1 7回 利付国庫債券 (30年)	270,000,000	310,551,300	
1 8回 利付国庫債券 (30年)	400,000,000	456,004,000	
1 9回 利付国庫債券 (30年)	280,000,000	319,485,600	
2 0回 利付国庫債券 (30年)	330,000,000	383,862,600	
2 1回 利付国庫債券 (30年)	310,000,000	354,066,500	

2 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	290,000,000	337,983,400	
2 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	350,000,000	408,051,000	
2 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	330,000,000	377,064,600	
2 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	620,000,000	716,292,200	
2 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	620,000,000	723,881,000	
2 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	770,000,000	898,551,500	
2 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	860,000,000	991,313,400	
3 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	880,000,000	1,001,545,600	
3 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	720,000,000	807,811,200	
3 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	970,000,000	1,100,018,800	
3 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,180,000,000	1,284,394,600	
3 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,200,000,000	1,338,648,000	
3 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,060,000,000	1,148,361,600	
3 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,370,000,000	1,480,257,600	
3 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,360,000,000	1,444,170,400	
3 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	850,000,000	886,235,500	
3 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,210,000,000	1,279,417,700	
4 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,030,000,000	1,069,891,900	
4 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,060,000,000	1,081,878,400	
4 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,300,000,000	1,326,052,000	
4 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,310,000,000	1,334,418,400	
4 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,130,000,000	1,150,362,600	
4 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,350,000,000	1,324,525,500	
4 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,770,000,000	1,733,555,700	
4 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,540,000,000	1,533,840,000	
4 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,620,000,000	1,552,462,200	

年)			
49回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,530,256,000	
50回 利付国庫債券(30年)	1,550,000,000	1,307,161,500	
51回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,210,204,800	
52回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,251,072,000	
53回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	973,987,000	
54回 利付国庫債券(30年)	1,590,000,000	1,327,538,700	
55回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	898,884,000	
56回 利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	945,823,800	
57回 利付国庫債券(30年)	1,530,000,000	1,265,386,500	
58回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,121,238,400	
59回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	897,713,600	
60回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	864,159,700	
61回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	843,823,600	
62回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	842,385,600	
63回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	800,668,000	
64回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	942,357,000	
65回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	939,289,000	
66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	783,677,300	
67回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,039,706,700	
68回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,164,378,600	
69回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,131,412,400	
70回 利付国庫債券(30年)	1,440,000,000	1,113,004,800	
71回 利付国庫債券(30年)	1,480,000,000	1,140,902,400	
72回 利付国庫債券(30年)	1,490,000,000	1,145,571,600	
73回 利付国庫債券(30年)	1,590,000,000	1,219,259,700	

7 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,390,000,000	1,156,327,100	
7 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,520,000,000	1,363,637,600	
7 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,420,000,000	1,304,710,200	
7 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,500,000,000	1,445,460,000	
7 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,400,000,000	1,283,828,000	
7 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,500,000,000	1,306,035,000	
8 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	400,000,000	402,736,000	
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	180,000,000	185,108,400	
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	70,000,000	71,798,300	
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	40,000,000	41,081,600	
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	250,000,000	257,545,000	
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	50,000,000	51,589,000	
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	90,000,000	93,003,300	
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	400,000,000	414,408,000	
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	140,000,000	145,301,800	
8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	70,000,000	72,962,400	
8 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	170,000,000	176,837,400	
8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	590,000,000	617,458,600	
8 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	120,000,000	126,146,400	
8 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	120,000,000	125,865,600	
8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	590,000,000	623,140,300	
8 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	10,000,000	10,535,800	
9 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	470,000,000	497,264,700	
9 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	110,000,000	116,692,400	
9 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1,160,000,000	1,228,440,000	
9 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	370,000,000	391,867,000	

年)			
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	711,828,100	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	590,194,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	127,914,000	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	708,252,600	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	171,089,600	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	804,330,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	896,101,200	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	250,286,000	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	545,880,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	173,958,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	118,602,000	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	691,590,400	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	542,680,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	650,316,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	740,970,300	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	376,684,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	478,143,600	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	503,672,400	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	806,222,600	
113回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,496,272,900	
114回 利付国庫債券(20年)	410,000,000	448,687,600	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	396,100,800	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	584,510,500	
117回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	515,453,700	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	606,420,750	

1 1 9回 利付国庫債券 (20年)	470,000,000	507,397,900	
1 2 1回 利付国庫債券 (20年)	640,000,000	695,648,000	
1 2 2回 利付国庫債券 (20年)	570,000,000	615,805,200	
1 2 3回 利付国庫債券 (20年)	350,000,000	385,612,500	
1 2 5回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	666,126,000	
1 2 6回 利付国庫債券 (20年)	510,000,000	558,852,900	
1 2 7回 利付国庫債券 (20年)	540,000,000	587,935,800	
1 2 8回 利付国庫債券 (20年)	370,000,000	403,044,700	
1 3 0回 利付国庫債券 (20年)	910,000,000	984,838,400	
1 3 2回 利付国庫債券 (20年)	30,000,000	32,249,700	
1 3 3回 利付国庫債券 (20年)	630,000,000	682,327,800	
1 3 4回 利付国庫債券 (20年)	200,000,000	216,748,000	
1 3 5回 利付国庫債券 (20年)	130,000,000	139,808,500	
1 3 6回 利付国庫債券 (20年)	360,000,000	384,332,400	
1 3 7回 利付国庫債券 (20年)	480,000,000	516,619,200	
1 3 8回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,123,292,600	
1 3 9回 利付国庫債券 (20年)	980,000,000	1,046,424,400	
1 4 0回 利付国庫債券 (20年)	2,250,000,000	2,422,350,000	
1 4 1回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,141,874,400	
1 4 2回 利付国庫債券 (20年)	430,000,000	466,863,900	
1 4 3回 利付国庫債券 (20年)	1,230,000,000	1,314,414,900	
1 4 4回 利付国庫債券 (20年)	750,000,000	794,610,000	
1 4 5回 利付国庫債券 (20年)	2,250,000,000	2,426,152,500	
1 4 6回 利付国庫債券 (20年)	2,240,000,000	2,415,235,200	
1 4 7回 利付国庫債券 (20年)	2,490,000,000	2,661,187,500	
1 4 8回 利付国庫債券 (20年)	2,530,000,000	2,677,448,400	

0年)			
149回 利付国庫債券 (20年)	2,590,000,000	2,739,002,700	
150回 利付国庫債券 (20年)	2,730,000,000	2,856,426,300	
151回 利付国庫債券 (20年)	3,060,000,000	3,133,654,200	
152回 利付国庫債券 (20年)	2,540,000,000	2,597,048,400	
153回 利付国庫債券 (20年)	2,340,000,000	2,414,201,400	
154回 利付国庫債券 (20年)	2,520,000,000	2,567,930,400	
155回 利付国庫債券 (20年)	2,480,000,000	2,466,682,400	
156回 利付国庫債券 (20年)	2,280,000,000	2,105,374,800	
157回 利付国庫債券 (20年)	2,180,000,000	1,953,192,800	
158回 利付国庫債券 (20年)	2,540,000,000	2,356,485,000	
159回 利付国庫債券 (20年)	2,240,000,000	2,097,356,800	
160回 利付国庫債券 (20年)	2,120,000,000	2,003,824,000	
161回 利付国庫債券 (20年)	2,460,000,000	2,286,102,600	
162回 利付国庫債券 (20年)	2,130,000,000	1,971,187,200	
163回 利付国庫債券 (20年)	2,230,000,000	2,055,011,900	
164回 利付国庫債券 (20年)	2,450,000,000	2,217,029,500	
165回 利付国庫債券 (20年)	2,050,000,000	1,846,517,000	
166回 利付国庫債券 (20年)	1,740,000,000	1,607,046,600	
167回 利付国庫債券 (20年)	2,150,000,000	1,919,584,500	
168回 利付国庫債券 (20年)	1,790,000,000	1,565,856,200	
169回 利付国庫債券 (20年)	1,920,000,000	1,644,345,600	
170回 利付国庫債券 (20年)	1,900,000,000	1,618,401,000	
171回 利付国庫債券 (20年)	1,840,000,000	1,558,719,200	
172回 利付国庫債券 (20年)	1,580,000,000	1,354,518,200	
173回 利付国庫債券 (20年)	1,560,000,000	1,331,070,000	

	174回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,038,056,000	
	175回 利付国庫債券(20年)	2,320,000,000	1,994,782,400	
	176回 利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	1,968,501,000	
	177回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,463,647,500	
	178回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,036,280,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,026,632,000	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	1,973,713,200	
	181回 利付国庫債券(20年)	2,010,000,000	1,813,522,500	
	182回 利付国庫債券(20年)	2,020,000,000	1,881,892,600	
	183回 利付国庫債券(20年)	1,960,000,000	1,918,075,600	
	184回 利付国庫債券(20年)	1,980,000,000	1,833,737,400	
	185回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,937,565,000	
	186回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	592,746,000	
	国債証券 合計	465,895,000,000	449,504,516,150	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,364,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	108,618,400	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	193,400,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	386,628,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	288,042,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	222,290,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	106,113,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,707,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	103,697,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	211,356,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	317,499,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,588,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,142,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	202,974,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,431,000	

債			
30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	394,464,000	
30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	392,528,000	
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	95,417,000	
36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	239,750,000	
213回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,589,000	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	195,780,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	191,578,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	284,715,000	
3回 神奈川県公募公債 3 0年	100,000,000	116,161,000	
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	108,185,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	327,456,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	107,358,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,204,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,423,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	190,062,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	190,640,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	189,666,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	188,436,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	282,426,000	
10回 大阪府公募公債 2 0年	200,000,000	213,056,000	
13回 大阪府公募公債 2 0年	100,000,000	100,228,000	
14回 大阪府公募公債 2 0年	100,000,000	91,564,000	
190回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	297,081,000	
26年度11回 京都府公募 公債	350,000,000	351,557,500	
29年度13回 京都府公募 公債	109,330,000	108,096,757	
令和2年度1回 京都府公募 公債	400,000,000	386,380,000	

令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	191,876,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	200,924,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	193,194,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	95,402,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	111,923,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	207,496,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	310,776,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	102,238,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	101,082,000	
令和元年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	193,512,000	
令和2年度10回 静岡県公募公債	100,000,000	96,055,000	
令和2年度14回 静岡県公募公債	200,000,000	190,692,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,675,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,779,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	201,616,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	103,724,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	325,572,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	327,312,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	107,707,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	209,506,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	145,852,500	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,590,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	195,154,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	210,354,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	98,666,000	
令和2年7回 広島県公募	200,000,000	191,790,000	

公債			
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	80,636,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	84,409,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	193,680,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	169,200,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	215,235,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	109,262,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	105,578,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	314,349,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	100,402,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,711,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	196,424,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	193,804,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	95,908,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	103,573,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	142,778,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	107,444,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	109,537,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	317,676,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	201,596,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,706,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	188,734,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	101,400,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	99,971,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	90,256,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	191,242,000	
5回 群馬県公募公債 20	100,000,000	104,569,000	

年			
1 4 2回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	501,580,000	
1 4 4回 共同発行市場公募 地方債	400,000,000	402,012,000	
1 4 6回 共同発行市場公募 地方債	600,000,000	604,086,000	
1 4 8回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	503,575,000	
1 5 0回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	301,953,000	
1 5 3回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	100,587,000	
1 5 7回 共同発行市場公募 地方債	120,000,000	119,562,000	
1 5 9回 共同発行市場公募 地方債	200,000,000	199,090,000	
1 6 0回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	497,255,000	
1 6 6回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	497,815,000	
1 6 9回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	497,530,000	
1 7 3回 共同発行市場公募 地方債	400,000,000	397,336,000	
1 7 4回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,010,000	
1 7 8回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,112,000	
1 7 9回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	495,370,000	
1 8 9回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	98,258,000	
1 9 4回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	292,206,000	
1 9 6回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	484,810,000	
2 0 3回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	96,505,000	
2 2 7回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	474,520,000	
2 2 8回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	472,185,000	
3 0年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,140,000	
令和2年度1回 福島県公募 公債	200,000,000	191,576,000	
2 6年度1回 浜松市公募公 債	100,000,000	100,304,000	
2 9年度4回 大阪市公募公 債	200,000,000	198,062,000	
令和2年 2回 大阪市公募	300,000,000	289,362,000	

公債			
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	216,530,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	192,562,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	104,525,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	100,588,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	106,327,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	218,990,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	213,094,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	296,010,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	150,194,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	386,652,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	114,430,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	107,570,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	104,584,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	107,837,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	272,679,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	196,686,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	217,524,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	107,621,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	107,291,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	326,124,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	104,474,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	110,985,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	181,146,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	83,659,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,435,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	182,530,000	

	債			
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	297,096,000	
	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	90,917,000	
	令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	296,979,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	193,540,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	191,576,000	
	26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	100,430,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	195,516,000	
地方債証券 合計		30,489,330,000	30,128,100,157	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	205,382,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	203,562,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	298,128,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	416,145,000	
	127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,695,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	75,589,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	378,076,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,776,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	361,263,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	174,678,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	231,118,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	354,903,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	257,124,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,779,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,172,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,863,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	96,838,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	97,956,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	89,303,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	176,568,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	89,828,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,739,000	
	116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,127,000	

1 2 1回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	536,015,000	
1 5 3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,304,000	
1 8 8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,909,000	
2 3 9回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	301,632,000	
2 4 1回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	502,545,000	
2 5 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,572,000	
2 5 4回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,554,000	
2 6 0回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	188,134,000	
第2 6 2回 政保道路債	500,000,000	496,755,000	
2 6 8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	91,898,000	
2 7 1回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	298,719,000	
2 8 6回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	178,672,000	
3 0 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,418,000	
3 0 9回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	794,656,000	
3 1 9回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	183,758,000	
3 3 7回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	90,625,000	
3 9 8回 政保道路債	300,000,000	214,011,000	
4 1 3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	135,918,000	
4 1 8回 高速道路機構債	200,000,000	147,718,000	
4 2 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	149,674,000	
2 8回 日本道路・機構承継債	500,000,000	581,305,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	214,606,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	326,646,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	327,087,000	
1 3回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	108,968,000	
7 9回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,392,000	
1 9回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	214,076,000	

23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	105,794,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	211,990,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,052,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,753,000	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	104,368,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	513,795,000	
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	294,312,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,442,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	201,790,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	295,368,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	398,292,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,401,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	91,824,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	496,425,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,269,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,933,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,483,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	245,409,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	216,441,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,840,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	214,656,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,581,820	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	103,884,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	102,469,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	202,058,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	151,614,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	105,353,000	
21回 政保中部国際空港債	100,000,000	100,501,000	

券			
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	216,744,000	
6 1 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,341,000	
7 5 回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	379,799,000	
8 0 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,608,000	
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,729,000	
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,792,000	
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	258,572,500	
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,034,000	
1 7 2 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,564,000	
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,564,000	
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,745,000	
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,802,000	
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,062,000	
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	495,695,000	
3 2 5 回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	495,695,000	
4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,736,000	40,962,084	
2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,851,000	15,376,131	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,970,000	97,993,795	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,608,000	146,977,775	
3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,971,000	20,634,436	
4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,072,000	17,656,545	
5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,000,000	20,570,400	
5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,051,000	21,635,375	
6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,722,000	26,298,944	
6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,348,000	64,129,714	

7 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	28,596,000	29,059,541	
8 2 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	34,842,000	34,961,508	
8 4 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	35,509,000	35,623,694	
8 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	39,185,000	39,206,943	
9 0 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	40,581,000	40,313,165	
9 3 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	45,985,000	44,796,747	
9 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	51,773,000	50,808,986	
9 9 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	53,635,000	52,933,990	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	202,995,000	193,133,502	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	68,919,000	65,904,482	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	68,499,000	65,596,012	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	68,716,000	65,733,038	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	214,935,000	204,254,879	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	214,599,000	203,811,108	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	146,480,000	138,958,252	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	219,489,000	207,801,210	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	217,704,000	206,178,750	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	379,130,000	360,052,178	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	75,501,000	71,624,778	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	77,957,000	73,081,569	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	251,874,000	234,333,494	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	335,216,000	312,773,288	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	258,324,000	241,122,204	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	263,907,000	246,362,462	
1 7 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	805,419,000	749,837,034	
6 回 沖繩振興開発金融公庫	400,000,000	412,064,000	

債券			
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,743,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	99,742,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	297,885,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	297,393,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	198,154,000	
369回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	398,896,000	
377回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	298,101,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	106,027,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,628,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	295,116,000	
85回 中日本高速道路債券	300,000,000	298,959,000	
87回 中日本高速道路債券	400,000,000	397,764,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,291,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	189,972,000	
特殊債券 合計	28,911,099,000	28,490,256,333	
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	292,572,000	
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	98,495,000	
27回 首都高速道路社債	400,000,000	398,244,000	
37回 成田国際空港社債	100,000,000	82,988,000	
57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,446,000	
67回 東日本高速道路社債	200,000,000	193,536,000	
79回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,873,000	
83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,582,000	
90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,474,000	
91回 中日本高速道路債券	500,000,000	495,635,000	
25回 西日本高速道路社債	200,000,000	200,866,000	
26回 西日本高速道路社債	100,000,000	100,664,000	
33回 西日本高速道路債券	300,000,000	298,986,000	
34回 西日本高速道路債券	200,000,000	199,526,000	
61回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,325,000	
62回 西日本高速道路債券	500,000,000	495,630,000	
24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,264,000	
10回 キリンホールディングス社債	100,000,000	100,507,000	
3回 ダイドーグループHD社債	300,000,000	288,579,000	
9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	92,020,000	
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	100,830,000	

14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,202,000	
30回 東レ社債	300,000,000	297,024,000	
42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	198,446,000	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	179,558,000	
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,007,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	286,671,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	468,625,000	
4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	286,044,000	
14回 プリヂェストン社債	300,000,000	292,602,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	297,165,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	99,733,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	95,034,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	187,722,000	
58回 川崎重工業社債	300,000,000	280,812,000	
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	98,363,000	
26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	198,604,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	88,817,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	387,252,000	
12回 新生銀行社債	400,000,000	398,592,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	105,977,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,246,000	
20回 三井住友信託銀行社債	300,000,000	296,889,000	
11回 セブン銀行社債	200,000,000	200,654,000	
28回 芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,522,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	295,800,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	383,388,000	
69回 ホンダファイナンス社債	300,000,000	297,237,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,767,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,244,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	191,382,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	284,019,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	97,167,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,240,000	
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,654,000	

31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	190,870,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	296,046,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	295,917,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	99,829,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	198,684,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	102,122,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	86,702,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	308,727,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	206,732,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	107,764,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,372,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	215,274,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	90,188,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	82,789,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	88,826,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,137,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	67,783,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,732,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	164,338,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	144,130,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,757,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	191,942,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	73,522,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	68,148,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,303,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	163,840,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,606,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	126,154,800	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	66,453,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	287,520,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	190,104,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	387,000,000	
30回 光通信社債	200,000,000	182,514,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	87,621,000	
532回 中部電力社債	200,000,000	192,028,000	
497回 関西電力社債	100,000,000	101,069,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	298,128,000	

530回	関西電力社債	400,000,000	387,368,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	164,002,000	
541回	関西電力社債	300,000,000	278,823,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	187,622,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	95,293,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	101,562,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	100,533,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	99,327,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	383,124,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	196,158,000	
536回	東北電力社債	300,000,000	277,374,000	
320回	四国電力社債	300,000,000	280,056,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	85,613,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	84,389,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	280,137,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	78,750,000	
493回	九州電力社債	200,000,000	198,100,000	
507回	九州電力社債	200,000,000	187,754,000	
321回	北海道電力社債	261,000,000	262,902,690	
340回	北海道電力社債	300,000,000	298,383,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	170,640,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	205,574,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	98,634,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	185,034,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	178,626,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	84,000,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	80,563,000	
57回	東京瓦斯社債	300,000,000	190,395,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,026,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	178,778,000	
社債券 合計		25,181,000,000	24,085,713,490	
合計			532,208,586,130	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,455,087,563
株式	464,832,873,580
派生商品評価勘定	186,955,590
未収入金	9,765,000
未収配当金	4,302,637,824
差入委託証拠金	670,263,483
流動資産合計	477,457,583,040
資産合計	477,457,583,040
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,864,830
前受金	105,695,000
未払解約金	93,270,000
流動負債合計	269,829,830
負債合計	269,829,830
純資産の部	
元本等	
元本	117,226,519,868
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	359,961,233,342
元本等合計	477,187,753,210
純資産合計	477,187,753,210
負債純資産合計	477,457,583,040

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11月12日 至 2023年11月13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11月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	112,340,543,501円
同期中追加設定元本額	63,160,467,685円
同期中一部解約元本額	58,274,491,318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	2,499,905,735円
たわらノーロード 国内株式くらっ専用>	3,603,293,699円
One DC 国内株式インデックスファンド	29,574,573,472円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,517,405,172円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,577,038円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	9,370,446円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	22,188,910円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	22,010,585円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,698,928円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	18,804,364円
たわらノーロード TOPIX	2,092,219,035円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,643,535,599円
たわらノーロード バランス (堅実型)	50,391,431円
たわらノーロード バランス (標準型)	361,095,886円
たわらノーロード バランス (積極型)	595,861,880円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	2,975,867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)	173,252,634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)	453,121,420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)	368,901,269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)	515,930,825円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	392,700円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,599,291円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	33,578,607円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,071,295円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	13,489,008円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,565,730,427円
O n eグローバルバランス	33,999,662円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	959,889,411円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,418,991,298円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,918,952,700円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	306,213,801円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	987,702,220円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,100,764,791円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,853,968円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,085,520,568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)	292,513,153円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	335,914,476円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	564,918,464円
投資のソムリエ	6,344,832,449円
クルーズコントロール	290,308,484円
投資のソムリエ<DC年金>	576,560,559円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	334,624,932円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,064,107,550円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	594,497,310円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,074,245,848円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	70,653,969円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	35,353,428円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,815,187円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	84,171,277円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,399,805円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	732,155,870円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	241,685,779円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	63,263,011円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	38,591,935円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	23,401,287円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	483,673,291円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,628,774円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,781,674円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	39,185,527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)	22,533,046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)	22,451,954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)	17,749,444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)	13,681,077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)	22,201,351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)	57,321,164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)	163,967,415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)	19,949,635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）	153,515,989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）	388,522,865円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	188,342,125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）	16,465,297円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	24,445,923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）	37,184,717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）	2,944,011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）	38,657,439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）	69,671,327円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,759,882円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	12,181,284円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,616,042円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	83,454円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,620,579円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	19,246,360円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	316,644,435円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	432,143,555円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,302,738,515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）	11,153,843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）	15,981,457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）	163,272,497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）	31,447,225円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	56,403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）	185,955,333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）	9,895,663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）	40,881,296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）	107,865,638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）	148,085,662円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	19,040,833円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	12,647,006円
動的パッケージファンド<DC年金>	27,443,352円
コア資産形成ファンド	16,711,663円
MHAMトピックスファンド	816,111,446円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	45,122,365円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,260,862,552円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,895,394,030円
計	117,226,519,868円
2. 受益権の総数	117,226,519,868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11月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。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11月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年11月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	59,111,014,208
合計	59,111,014,208

(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（2023年2月8日から2023年11月13日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年11月13日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 先物取引 買建	12,233,655,000	—	12,349,920,000	116,265,000
合計	12,233,655,000	—	12,349,920,000	116,265,000

(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11月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.0706円 (40,706円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年11月13日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	7,500	3,690.00	27,675,000	
ニッセイ	196,100	708.70	138,976,070	
マルハニチロ	29,100	2,816.50	81,960,150	
雪国まいたけ	16,700	935.00	15,614,500	
カネコ種苗	6,000	1,406.00	8,436,000	
サカタのタネ	22,300	4,050.00	90,315,000	
ホクト	15,700	1,770.00	27,789,000	
ホクリヨウ	1,800	980.00	1,764,000	
ショーボンドホールディングス	26,700	6,184.00	165,112,800	
ミライト・ワン	64,800	1,800.50	116,672,400	
タマホーム	12,400	3,625.00	44,950,000	
サンヨーホームズ	1,400	718.00	1,005,200	
日本アクア	4,600	912.00	4,195,200	
ファーストコーポレーション	2,800	750.00	2,100,000	
ベステラ	2,600	987.00	2,566,200	
Robot Home	38,200	195.00	7,449,000	
キャンディル	2,000	588.00	1,176,000	
住石ホールディングス	19,400	648.00	12,571,200	

日鉄鉱業	7,900	5,150.00	40,685,000
三井松島ホールディングス	11,600	2,772.00	32,155,200
I N P E X	725,300	2,028.00	1,470,908,400
石油資源開発	22,700	5,450.00	123,715,000
K&Oエナジーグループ	8,900	2,309.00	20,550,100
ダイセキ環境ソリューション	2,200	962.00	2,116,400
第一カッター興業	5,100	1,268.00	6,466,800
明豊ファシリティワークス	4,100	786.00	3,222,600
安藤・間	113,600	1,073.00	121,892,800
東急建設	61,500	795.00	48,892,500
コムシスホールディングス	62,600	3,250.00	203,450,000
ビーアールホールディングス	28,900	349.00	10,086,100
高松コンストラクショングループ	14,500	2,687.00	38,961,500
東建コーポレーション	5,600	8,040.00	45,024,000
ソネック	1,200	949.00	1,138,800
ヤマウラ	10,000	1,250.00	12,500,000
オリエンタル白石	72,600	319.00	23,159,400
大成建設	128,400	5,102.00	655,096,800
大林組	490,700	1,306.50	641,099,550
清水建設	389,000	968.90	376,902,100
飛島建設	14,100	1,326.00	18,696,600
長谷工コーポレーション	125,900	1,834.00	230,900,600
松井建設	12,900	762.00	9,829,800
銭高組	1,100	3,460.00	3,806,000
鹿島建設	304,200	2,455.50	746,963,100
不動テトラ	9,500	2,090.00	19,855,000
大末建設	3,100	1,302.00	4,036,200
鉄建建設	9,900	2,022.00	20,017,800
西松建設	26,200	3,680.00	96,416,000
三井住友建設	102,100	403.00	41,146,300
大豊建設	4,800	3,520.00	16,896,000
佐田建設	4,900	660.00	3,234,000
ナカノフドー建設	5,500	394.00	2,167,000
奥村組	22,200	4,560.00	101,232,000
東鉄工業	17,000	2,850.00	48,450,000
イチケン	2,000	2,292.00	4,584,000
富士ピー・エス	3,500	445.00	1,557,500
浅沼組	10,200	3,695.00	37,689,000
戸田建設	185,700	902.50	167,594,250
熊谷組	23,000	3,590.00	82,570,000
北野建設	1,500	3,100.00	4,650,000
植木組	2,200	1,428.00	3,141,600
矢作建設工業	18,700	1,286.00	24,048,200
ピーエス三菱	17,500	945.00	16,537,500
日本ハウスホールディングス	29,300	333.00	9,756,900
大東建託	50,500	15,960.00	805,980,000
新日本建設	19,300	1,161.00	22,407,300
東亜道路工業	5,500	6,680.00	36,740,000
日本道路	16,100	1,883.00	30,316,300
東亜建設工業	10,600	3,725.00	39,485,000

日本国土開発	39,100	606.00	23,694,600
若築建設	4,800	2,928.00	14,054,400
東洋建設	34,600	1,231.00	42,592,600
五洋建設	194,400	800.10	155,539,440
世紀東急工業	17,700	1,625.00	28,762,500
福田組	5,200	5,050.00	26,260,000
日本ドライケミカル	1,900	2,330.00	4,427,000
住友林業	118,500	3,580.00	424,230,000
日本基礎技術	4,700	452.00	2,124,400
巴コーポレーション	9,700	571.00	5,538,700
大和ハウス工業	379,400	4,241.00	1,609,035,400
ライト工業	28,300	1,977.00	55,949,100
積水ハウス	416,100	2,991.00	1,244,555,100
日特建設	13,200	1,026.00	13,543,200
北陸電気工事	9,500	991.00	9,414,500
ユアテック	30,200	959.00	28,961,800
日本リーテック	10,700	1,235.00	13,214,500
四電工	5,700	2,897.00	16,512,900
中電工	21,300	2,406.00	51,247,800
関電工	85,900	1,388.00	119,229,200
きんでん	96,600	2,295.00	221,697,000
東京エネシス	13,600	964.00	13,110,400
トーエネック	4,600	4,150.00	19,090,000
住友電設	13,100	2,580.00	33,798,000
日本電設工業	25,800	1,989.00	51,316,200
エクシオグループ	69,000	3,236.00	223,284,000
新日本空調	8,900	2,201.00	19,588,900
九電工	29,700	4,438.00	131,808,600
三機工業	29,700	1,829.00	54,321,300
日揮ホールディングス	135,800	1,570.50	213,273,900
中外炉工業	4,500	2,119.00	9,535,500
ヤマト	6,300	921.00	5,802,300
太平電業	8,500	3,965.00	33,702,500
高砂熱学工業	36,800	3,100.00	114,080,000
三晃金属工業	1,000	4,785.00	4,785,000
NEC ネットズエスアイ	54,600	2,116.00	115,533,600
朝日工業社	6,400	2,599.00	16,633,600
明星工業	26,600	1,120.00	29,792,000
大気社	15,800	4,570.00	72,206,000
ダイダン	18,100	1,504.00	27,222,400
日比谷総合設備	10,000	2,204.00	22,040,000
ニッポン	41,200	2,290.00	94,348,000
日清製粉グループ本社	127,300	2,191.00	278,914,300
日東富士製粉	2,300	4,730.00	10,879,000
昭和産業	13,300	3,005.00	39,966,500
鳥越製粉	6,900	680.00	4,692,000
中部飼料	19,000	1,047.00	19,893,000
フィード・ワン	20,200	761.00	15,372,200
東洋精糖	1,500	1,906.00	2,859,000
日本甜菜製糖	8,000	1,925.00	15,400,000

DM三井製糖ホールディングス	13,600	3,065.00	41,684,000
塩水港精糖	10,100	237.00	2,393,700
ウェルネオシュガー	6,900	2,026.00	13,979,400
L I F U L L	49,100	236.00	11,587,600
M I X I	30,800	2,312.00	71,209,600
ジェイエイシーリクルートメント	13,000	2,394.00	31,122,000
日本M&Aセンターホールディングス	229,100	643.60	147,448,760
メンバーズ	4,900	1,074.00	5,262,600
中広	1,000	426.00	426,000
UTグループ	19,000	2,137.00	40,603,000
アイティメディア	5,500	937.00	5,153,500
E・Jホールディングス	8,400	1,596.00	13,406,400
オープンアップグループ	43,100	2,056.00	88,613,600
コシダカホールディングス	43,000	1,050.00	45,150,000
アルトナー	3,300	1,765.00	5,824,500
パソナグループ	17,500	1,419.00	24,832,500
CDS	2,000	1,725.00	3,450,000
リンクアンドモチベーション	41,400	416.00	17,222,400
エス・エム・エス	50,400	2,523.00	127,159,200
サニーサイドアップグループ	2,400	794.00	1,905,600
パーソルホールディングス	1,463,800	235.20	344,285,760
リニカル	5,200	598.00	3,109,600
クックパッド	39,500	116.00	4,582,000
エスクリ	3,200	262.00	838,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,900	646.00	2,519,400
森永製菓	29,500	5,663.00	167,058,500
中村屋	3,400	3,085.00	10,489,000
江崎グリコ	39,400	4,149.00	163,470,600
名糖産業	5,400	1,615.00	8,721,000
井村屋グループ	8,200	2,307.00	18,917,400
不二家	9,500	2,494.00	23,693,000
山崎製パン	92,100	3,182.00	293,062,200
第一屋製パン	1,500	489.00	733,500
モロゾフ	4,500	3,805.00	17,122,500
亀田製菓	7,900	3,895.00	30,770,500
寿スピリッツ	65,100	2,342.00	152,464,200
カルビー	63,000	2,682.50	168,997,500
森永乳業	25,000	5,620.00	140,500,000
六甲バター	10,200	1,433.00	14,616,600
ヤクルト本社	196,800	3,711.00	730,324,800
明治ホールディングス	168,900	3,328.00	562,099,200
雪印メグミルク	33,300	2,275.00	75,757,500
プリマハム	18,500	2,228.00	41,218,000
日本ハム	59,200	4,340.00	256,928,000
林兼産業	2,600	572.00	1,487,200
丸大食品	13,800	1,598.00	22,052,400
S F o o d s	15,200	3,250.00	49,400,000
柿安本店	5,400	2,460.00	13,284,000
伊藤ハム米久ホールディングス	21,100	3,950.00	83,345,000
学情	7,300	1,806.00	13,183,800

スタジオアリス	7,200	2,049.00	14,752,800
クロスキャット	8,900	1,124.00	10,003,600
シミックホールディングス	6,900	2,644.00	18,243,600
エプロ	2,300	770.00	1,771,000
システナ	212,200	259.00	54,959,800
N J S	3,100	2,652.00	8,221,200
デジタルアーツ	8,800	4,620.00	40,656,000
日鉄ソリューションズ	23,900	4,610.00	110,179,000
総合警備保障	240,300	861.40	206,994,420
キューブシステム	7,500	1,093.00	8,197,500
いちご	158,600	342.00	54,241,200
日本駐車場開発	145,700	203.00	29,577,100
コア	6,200	1,735.00	10,757,000
カカコム	94,900	1,618.50	153,595,650
アイロムグループ	5,800	1,963.00	11,385,400
セントケア・ホールディング	10,500	907.00	9,523,500
サイネックス	1,400	790.00	1,106,000
ルネサンス	11,100	870.00	9,657,000
ディップ	22,000	3,060.00	67,320,000
S B Sホールディングス	12,500	2,562.00	32,025,000
デジタルホールディングス	7,500	1,125.00	8,437,500
新日本科学	13,100	1,580.00	20,698,000
キャリアデザインセンター	1,700	1,825.00	3,102,500
ベネフィット・ワン	50,000	1,162.50	58,125,000
エムスリー	284,200	2,483.50	705,810,700
ツカダ・グローバルホールディング	5,200	373.00	1,939,600
プラス	900	645.00	580,500
アウトソーシング	92,200	1,231.00	113,498,200
ウェルネット	6,000	557.00	3,342,000
ワールドホールディングス	6,400	2,464.00	15,769,600
ディー・エヌ・エー	51,100	1,491.50	76,215,650
博報堂D Yホールディングス	183,400	1,281.00	234,935,400
ぐるなび	26,800	291.00	7,798,800
タカミヤ	19,500	470.00	9,165,000
ジャパンベストレスキューシステム	7,200	650.00	4,680,000
ファンコミュニケーションズ	20,200	405.00	8,181,000
ライク	5,300	1,390.00	7,367,000
A o b a - B B T	3,000	404.00	1,212,000
エスプール	41,300	381.00	15,735,300
W D Bホールディングス	7,400	2,118.00	15,673,200
手間いらず	2,400	2,472.00	5,932,800
ティア	4,700	450.00	2,115,000
C D G	900	1,207.00	1,086,300
アドウェイズ	19,700	521.00	10,263,700
バリューコマース	12,700	1,190.00	15,113,000
インフォマート	149,300	441.00	65,841,300
サッポロホールディングス	45,300	5,838.00	264,461,400
アサヒグループホールディングス	318,300	5,870.00	1,868,421,000
キリンホールディングス	573,800	2,175.00	1,248,015,000
宝ホールディングス	94,000	1,205.50	113,317,000

オエノンホールディングス	41,200	377.00	15,532,400
養命酒製造	4,600	1,851.00	8,514,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	107,900	2,057.50	222,004,250
ライフドリンク カンパニー	2,100	4,000.00	8,400,000
サントリー食品インターナショナル	97,000	4,634.00	449,498,000
ダイドーグループホールディングス	7,800	5,840.00	45,552,000
伊藤園	46,600	4,845.00	225,777,000
キーコーヒー	15,500	2,059.00	31,914,500
ユニカフェ	2,600	952.00	2,475,200
ジャパンフーズ	1,200	1,174.00	1,408,800
日清オイリオグループ	19,400	4,290.00	83,226,000
不二製油グループ本社	32,100	2,418.00	77,617,800
かどや製油	900	3,530.00	3,177,000
J-オイルミルズ	15,800	1,965.00	31,047,000
ローソン	31,500	7,241.00	228,091,500
サンエー	11,300	4,505.00	50,906,500
カワチ薬品	11,500	2,395.00	27,542,500
エービーシー・マート	64,800	2,440.50	158,144,400
ハードオフコーポレーション	4,600	1,483.00	6,821,800
高千穂交易	4,200	3,230.00	13,566,000
アスクル	30,600	2,012.00	61,567,200
ゲオホールディングス	16,600	2,171.00	36,038,600
アダストリア	17,900	3,250.00	58,175,000
ジーフット	6,800	286.00	1,944,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	681.00	681,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,200	1,799.00	2,158,800
伊藤忠食品	3,300	7,080.00	23,364,000
くら寿司	17,300	3,530.00	61,069,000
キャンドウ	5,300	2,512.00	13,313,600
エレマテック	13,300	1,698.00	22,583,400
I Kホールディングス	2,700	346.00	934,200
パルグループホールディングス	29,100	2,000.00	58,200,000
エディオン	58,600	1,489.00	87,255,400
あらた	11,300	6,320.00	71,416,000
サーラコーポレーション	31,200	730.00	22,776,000
ワッツ	4,100	544.00	2,230,400
トーメンデバイス	2,200	5,060.00	11,132,000
ハローズ	6,800	4,335.00	29,478,000
J Pホールディングス	36,800	359.00	13,211,200
フジオフードグループ本社	16,600	1,417.00	23,522,200
あみやき亭	3,600	3,750.00	13,500,000
東京エレクトロン デバイス	14,700	4,070.00	59,829,000
ひらまつ	19,600	244.00	4,782,400
円谷フィールズホールディングス	25,400	1,536.00	39,014,400
双日	164,700	3,082.00	507,605,400
アルフレッサ ホールディングス	148,500	2,485.50	369,096,750
大黒天物産	4,600	6,190.00	28,474,000
ハニーズホールディングス	11,600	1,609.00	18,664,400
ファーマライズホールディングス	1,800	653.00	1,175,400

キッコーマン	91,300	9,695.00	885,153,500
味の素	327,300	5,736.00	1,877,392,800
ブルドックソース	7,300	2,083.00	15,205,900
キューピー	74,100	2,553.50	189,214,350
ハウス食品グループ本社	47,500	3,334.00	158,365,000
カゴメ	59,200	3,163.00	187,249,600
焼津水産化学工業	3,300	1,184.00	3,907,200
アリアケジャパン	13,700	4,590.00	62,883,000
ピエトロ	1,000	1,811.00	1,811,000
エバラ食品工業	3,300	2,884.00	9,517,200
やまみ	700	2,701.00	1,890,700
ニチレイ	63,200	3,242.00	204,894,400
横浜冷凍	40,300	1,182.00	47,634,600
東洋水産	69,600	8,021.00	558,261,600
イトアンドホールディングス	6,200	1,978.00	12,263,600
大冷	1,100	1,936.00	2,129,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,200	1,085.00	6,727,000
日清食品ホールディングス	48,400	15,025.00	727,210,000
永谷園ホールディングス	6,800	2,192.00	14,905,600
一正蒲鉾	3,300	726.00	2,395,800
フジッコ	14,100	1,973.00	27,819,300
ロック・フィールド	15,400	1,625.00	25,025,000
日本たばこ産業	836,900	3,742.00	3,131,679,800
ケンコーマヨネーズ	9,500	1,557.00	14,791,500
わらべや日洋ホールディングス	9,200	3,455.00	31,786,000
なとり	8,700	2,028.00	17,643,600
イフジ産業	1,500	1,361.00	2,041,500
ファーマフーズ	19,700	1,348.00	26,555,600
北の達人コーポレーション	59,100	192.00	11,347,200
ユーグレナ	85,700	753.00	64,532,100
紀文食品	11,900	1,180.00	14,042,000
ピククルスホールディングス	8,100	1,201.00	9,728,100
スター・マイカ・ホールディングス	16,000	602.00	9,632,000
SREホールディングス	5,900	2,492.00	14,702,800
ADワークスグループ	19,200	245.00	4,704,000
片倉工業	12,900	1,659.00	21,401,100
グンゼ	10,000	4,810.00	48,100,000
ヒューリック	321,300	1,388.00	445,964,400
神栄	1,200	1,773.00	2,127,600
ラサ商事	5,300	1,674.00	8,872,200
アルペン	12,200	1,894.00	23,106,800
ハブ	2,700	729.00	1,968,300
ラクーンホールディングス	11,600	713.00	8,270,800
クオールホールディングス	20,400	1,644.00	33,537,600
アルコニックス	19,400	1,330.00	25,802,000
神戸物産	114,500	3,607.00	413,001,500
ソリトンシステムズ	7,300	1,221.00	8,913,300
ジンズホールディングス	8,800	4,425.00	38,940,000
ビックカメラ	78,700	1,166.00	91,764,200
DCMホールディングス	78,200	1,154.00	90,242,800

ペッパーフードサービス	33,800	111.00	3,751,800
ハイパー	1,900	299.00	568,100
MonotaRO	209,800	1,441.00	302,321,800
東京一番フーズ	1,900	511.00	970,900
DDグループ	5,300	1,364.00	7,229,200
あいホールディングス	23,700	2,354.00	55,789,800
ディーブイエックス	2,300	1,032.00	2,373,600
きちりホールディングス	2,000	909.00	1,818,000
J. フロント リテイリング	169,800	1,444.50	245,276,100
ドトール・日レスホールディングス	26,300	2,165.00	56,939,500
マツキヨココカラ&カンパニー	269,200	2,637.00	709,880,400
ブロンコビリー	8,700	3,105.00	27,013,500
ZOZO	97,800	3,009.00	294,280,200
トレジャー・ファクトリー	7,200	1,161.00	8,359,200
物語コーポレーション	24,700	3,755.00	92,748,500
三越伊勢丹ホールディングス	249,200	1,735.00	432,362,000
東洋紡	60,500	1,004.00	60,742,000
ユニチカ	45,400	185.00	8,399,000
富士紡ホールディングス	6,100	3,580.00	21,838,000
日清紡ホールディングス	106,200	1,106.50	117,510,300
倉敷紡績	10,500	2,434.00	25,557,000
ダイワボウホールディングス	65,500	2,956.50	193,650,750
シキボウ	6,400	1,075.00	6,880,000
日東紡績	17,800	4,015.00	71,467,000
トヨタ紡織	58,900	2,677.00	157,675,300
マクニカホールディングス	35,000	6,457.00	225,995,000
Hamee	5,100	981.00	5,003,100
マーケットエンタープライズ	800	1,114.00	891,200
ラクト・ジャパン	5,700	1,987.00	11,325,900
ウエルシアホールディングス	76,800	2,476.50	190,195,200
クリエイトSDホールディングス	24,500	3,110.00	76,195,000
グリムス	6,200	2,010.00	12,462,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	22,400	1,064.00	23,833,600
八洲電機	11,900	1,281.00	15,243,900
メディアスホールディングス	9,500	737.00	7,001,500
レスターホールディングス	12,600	2,507.00	31,588,200
ジオリーヴグループ	1,900	1,188.00	2,257,200
丸善CHIホールディングス	9,800	327.00	3,204,600
大光	3,500	664.00	2,324,000
OCHIホールディングス	1,900	1,378.00	2,618,200
TOKAIホールディングス	80,300	982.00	78,854,600
黒谷	2,400	581.00	1,394,400
ミサワ	1,800	638.00	1,148,400
ティーライフ	1,100	1,370.00	1,507,000
Cominix	1,700	757.00	1,286,900
エー・ピーホールディングス	2,000	875.00	1,750,000
三洋貿易	16,700	1,270.00	21,209,000
チムニー	2,600	1,398.00	3,634,800
シュッピン	13,400	1,209.00	16,200,600

ビューティガレージ	4,600	2,443.00	11,237,800
オイシックス・ラ・大地	19,900	1,385.00	27,561,500
ウイン・パートナーズ	9,700	1,210.00	11,737,000
ネクステージ	33,800	2,166.00	73,210,800
ジョイフル本田	43,100	1,758.00	75,769,800
鳥貴族ホールディングス	5,500	2,841.00	15,625,500
ホットランド	11,300	2,043.00	23,085,900
すかいらーくホールディングス	202,300	2,295.50	464,379,650
SFPホールディングス	8,100	2,320.00	18,792,000
綿半ホールディングス	11,500	1,351.00	15,536,500
日本毛織	37,000	1,381.00	51,097,000
ダイトウボウ	12,700	86.00	1,092,200
トーア紡コーポレーション	3,000	454.00	1,362,000
ダイドーリミテッド	11,200	334.00	3,740,800
ヨシックスホールディングス	2,700	2,953.00	7,973,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,300	1,044.00	43,117,200
野村不動産ホールディングス	76,700	3,628.00	278,267,600
三重交通グループホールディングス	29,500	560.00	16,520,000
サムティ	21,900	2,435.00	53,326,500
ディア・ライフ	23,500	760.00	17,860,000
コーセーアールイー	2,400	1,003.00	2,407,200
地主	10,500	2,065.00	21,682,500
プレサンスコーポレーション	21,800	1,633.00	35,599,400
フィル・カンパニー	2,200	519.00	1,141,800
THEグローバル社	4,500	395.00	1,777,500
ハウスコム	1,200	807.00	968,400
JPMC	8,000	1,117.00	8,936,000
サンセイランディック	2,300	1,036.00	2,382,800
エストラスト	800	626.00	500,800
フージャースホールディングス	21,200	1,041.00	22,069,200
オープンハウスグループ	50,500	5,022.00	253,611,000
東急不動産ホールディングス	414,100	913.10	378,114,710
飯田グループホールディングス	132,000	2,272.50	299,970,000
イーグランド	1,100	1,471.00	1,618,100
ムゲンエステート	5,100	1,169.00	5,961,900
帝国繊維	15,800	1,917.00	30,288,600
日本コークス工業	142,300	110.00	15,653,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,600	709.00	4,679,400
ミタチ産業	2,100	1,045.00	2,194,500
BENOS	6,000	1,393.00	8,358,000
あさひ	13,700	1,299.00	17,796,300
日本調剤	10,100	1,266.00	12,786,600
コスモス薬品	14,600	15,735.00	229,731,000
シップヘルスケアホールディングス	53,200	2,122.00	112,890,400
トーエル	3,700	692.00	2,560,400
ソフトクリエイトホールディングス	11,500	1,765.00	20,297,500
セブン&アイ・ホールディングス	510,000	5,659.00	2,886,090,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	100,100	1,032.00	103,303,200

明治電機工業	5,500	1,401.00	7,705,500
ツルハホールディングス	31,100	10,840.00	337,124,000
デリカフーズホールディングス	3,500	583.00	2,040,500
スターティアホールディングス	2,200	1,301.00	2,862,200
サンマルクホールディングス	11,900	1,900.00	22,610,000
フェリシモ	1,900	904.00	1,717,600
トリドールホールディングス	41,400	3,693.00	152,890,200
帝人	134,600	1,328.50	178,816,100
東レ	938,800	760.70	714,145,160
クラレ	204,100	1,590.00	324,519,000
旭化成	947,800	1,001.50	949,221,700
TOKYO BASE	17,800	294.00	5,233,200
稲葉製作所	7,600	1,512.00	11,491,200
宮地エンジニアリンググループ	7,300	3,090.00	22,557,000
トーカロ	41,700	1,449.00	60,423,300
アルファ	2,900	1,389.00	4,028,100
SUMCO	256,500	2,115.00	542,497,500
川田テクノロジーズ	3,400	7,040.00	23,936,000
RS Technologies	9,700	2,443.00	23,697,100
ジェイテックコーポレーション	1,000	2,067.00	2,067,000
信和	5,200	734.00	3,816,800
ビーロッド	5,200	835.00	4,342,000
ファーストブラザーズ	1,500	1,104.00	1,656,000
And Doホールディングス	8,300	1,009.00	8,374,700
シーアールイー	7,700	1,565.00	12,050,500
ケイアイスター不動産	6,600	4,060.00	26,796,000
アグレ都市デザイン	1,400	1,466.00	2,052,400
グッドコムアセット	12,800	916.00	11,724,800
ジェイ・エス・ビー	6,900	2,418.00	16,684,200
ロードスターキャピタル	8,900	1,997.00	17,773,300
テンポイノベーション	2,300	1,097.00	2,523,100
グローバル・リンク・マネジメント	1,500	1,997.00	2,995,500
フェイスネットワーク	2,100	1,281.00	2,690,100
住江織物	1,600	2,191.00	3,505,600
日本フェルト	4,800	418.00	2,006,400
イチカラ	900	1,654.00	1,488,600
エコナックホールディングス	7,100	142.00	1,008,200
日東製網	800	1,436.00	1,148,800
芦森工業	1,600	2,158.00	3,452,800
アツギ	5,500	432.00	2,376,000
ウイルプラスホールディングス	1,400	1,217.00	1,703,800
JMホールディングス	11,200	2,027.00	22,702,400
コメダホールディングス	36,300	2,778.00	100,841,400
サツドラホールディングス	3,700	763.00	2,823,100
アレンザホールディングス	11,100	999.00	11,088,900
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,676.00	6,536,400
パロックジャパンリミテッド	11,500	796.00	9,154,000
クスリのアオキホールディングス	13,200	9,502.00	125,426,400
ダイニック	2,500	756.00	1,890,000
共和レザー	4,600	729.00	3,353,400

ピーバンドットコム	1,000	393.00	393,000
力の源ホールディングス	6,600	1,761.00	11,622,600
FOOD & LIFE COMPANIES	78,900	2,666.50	210,386,850
アセンテック	5,700	524.00	2,986,800
セーレン	27,000	2,381.00	64,287,000
ソトー	2,500	697.00	1,742,500
東海染工	800	950.00	760,000
小松マテーレ	20,400	798.00	16,279,200
ワコールホールディングス	28,700	3,277.00	94,049,900
ホギメディカル	18,500	3,335.00	61,697,500
クラウドディアホールディングス	1,800	408.00	734,400
T S I ホールディングス	47,200	815.00	38,468,000
マツオカコーポレーション	2,400	1,535.00	3,684,000
ワールド	19,700	1,600.00	31,520,000
T I S	153,400	2,985.00	457,899,000
テクミラホールディングス	3,600	444.00	1,598,400
グリー	37,600	540.00	20,304,000
GMOペパボ	1,700	1,232.00	2,094,400
コーエーテクモホールディングス	87,900	1,962.50	172,503,750
三菱総合研究所	6,900	4,650.00	32,085,000
ボルテージ	2,300	263.00	604,900
電算	800	1,501.00	1,200,800
A G S	3,200	710.00	2,272,000
ファインデックス	11,100	806.00	8,946,600
ブレインパッド	10,500	1,015.00	10,657,500
K L a b	25,800	270.00	6,966,000
ポルトゥウィンホールディングス	24,000	475.00	11,400,000
ネクソン	313,400	2,991.50	937,536,100
アイスタイル	41,700	449.00	18,723,300
エムアップホールディングス	17,100	1,192.00	20,383,200
エイチーム	8,300	653.00	5,419,900
エニグモ	17,900	352.00	6,300,800
テクノスジャパン	7,000	612.00	4,284,000
e n i s h	7,000	149.00	1,043,000
コロブラ	54,400	582.00	31,660,800
オルトプラス	6,800	176.00	1,196,800
ブロードリーフ	66,600	494.00	32,900,400
クロス・マーケティンググループ	4,700	677.00	3,181,900
デジタルハーツホールディングス	8,700	819.00	7,125,300
メディアドゥ	6,300	1,405.00	8,851,500
じげん	40,900	519.00	21,227,100
ブイキューブ	16,800	382.00	6,417,600
エンカレッジ・テクノロジー	1,900	512.00	972,800
サイバーリンクス	3,000	725.00	2,175,000
ディー・エル・イー	5,600	224.00	1,254,400
フィックスターズ	15,800	1,146.00	18,106,800
CARTA HOLDINGS	6,500	1,223.00	7,949,500
オブティム	14,400	867.00	12,484,800
セレス	5,600	980.00	5,488,000

SHIFT	9,300	32,530.00	302,529,000
特種東海製紙	7,700	3,615.00	27,835,500
ティーガイア	14,600	1,788.00	26,104,800
セック	1,500	3,930.00	5,895,000
テクマトリックス	25,700	1,686.00	43,330,200
プロシップ	6,800	1,315.00	8,942,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,600	2,254.50	82,514,700
GMOペイメントゲートウェイ	28,000	7,649.00	214,172,000
ザッパラス	2,200	473.00	1,040,600
システムリサーチ	4,800	3,205.00	15,384,000
インターネットイニシアティブ	67,100	2,588.00	173,654,800
さくらインターネット	15,700	1,187.00	18,635,900
ヴィンクス	1,900	2,014.00	3,826,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	2,650.00	11,395,000
SRAホールディングス	7,200	3,500.00	25,200,000
システムインテグレータ	2,300	397.00	913,100
朝日ネット	15,100	622.00	9,392,200
eBASE	19,700	749.00	14,755,300
アバントグループ	17,800	1,392.00	24,777,600
アドソル日進	5,900	1,604.00	9,463,600
ODKソリューションズ	1,600	550.00	880,000
フリービット	7,400	1,056.00	7,814,400
コムチュア	20,300	1,980.00	40,194,000
サイバーコム	1,200	1,900.00	2,280,000
アステリア	11,000	742.00	8,162,000
アイル	6,500	3,865.00	25,122,500
王子ホールディングス	583,700	577.20	336,911,640
日本製紙	79,000	1,261.00	99,619,000
三菱製紙	10,500	561.00	5,890,500
北越コーポレーション	68,900	1,298.00	89,432,200
中越パルプ工業	3,100	1,550.00	4,805,000
巴川製紙所	2,200	652.00	1,434,400
大王製紙	61,900	1,032.00	63,880,800
阿波製紙	2,200	423.00	930,600
マークラインズ	7,600	2,867.00	21,789,200
メディカル・データ・ビジョン	16,700	704.00	11,756,800
gumi	20,700	417.00	8,631,900
ショーケース	1,800	296.00	532,800
モバイルファクトリー	1,700	714.00	1,213,800
テラスカイ	6,000	1,457.00	8,742,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,100	1,581.00	12,806,100
PCIホールディングス	3,000	930.00	2,790,000
アイビーシー	1,200	526.00	631,200
ネオジャパン	4,700	1,001.00	4,704,700
PR TIMES	2,800	1,677.00	4,695,600
ラクス	66,400	2,178.50	144,652,400
ランドコンピュータ	4,600	682.00	3,137,200

ダブルスタンダード	4,300	1,390.00	5,977,000
オープンドア	8,200	875.00	7,175,000
マイネット	2,500	310.00	775,000
アカツキ	6,600	2,187.00	14,434,200
ベネフィットジャパン	500	1,173.00	586,500
U b i c o mホールディングス	4,400	1,606.00	7,066,400
カナミックネットワーク	15,100	475.00	7,172,500
ノムラシステムコーポレーション	8,600	109.00	937,400
レンゴー	127,600	922.00	117,647,200
トーモク	8,100	2,121.00	17,180,100
ザ・パック	10,400	3,230.00	33,592,000
チェンジホールディングス	30,500	1,614.00	49,227,000
シンクロ・フード	4,900	600.00	2,940,000
オークネット	5,500	1,827.00	10,048,500
キャピタル・アセット・プランニング	1,600	700.00	1,120,000
セグエグループ	2,500	927.00	2,317,500
エイトレッド	1,100	1,324.00	1,456,400
マクロミル	27,500	660.00	18,150,000
ビーグリー	1,700	1,089.00	1,851,300
オロ	5,100	2,152.00	10,975,200
ユーザーローカル	5,100	1,713.00	8,736,300
テモナ	1,800	246.00	442,800
ニーズウェル	4,300	662.00	2,846,600
マネーフォワード	31,200	4,361.00	136,063,200
サインポスト	3,000	444.00	1,332,000
レゾナック・ホールディングス	135,400	2,629.50	356,034,300
住友化学	1,039,600	386.30	401,597,480
住友精化	6,500	5,030.00	32,695,000
日産化学	65,900	5,760.00	379,584,000
ラサ工業	5,400	1,953.00	10,546,200
クレハ	10,200	8,290.00	84,558,000
多木化学	5,500	3,230.00	17,765,000
テイカ	12,200	1,375.00	16,775,000
石原産業	23,300	1,366.00	31,827,800
片倉コープアグリ	1,900	1,125.00	2,137,500
日本曹達	16,500	5,240.00	86,460,000
東ソー	187,100	1,902.50	355,957,750
トクヤマ	45,300	2,321.50	105,163,950
セントラル硝子	15,000	2,620.00	39,300,000
東亜合成	70,200	1,386.50	97,332,300
大阪ソーダ	9,800	9,250.00	90,650,000
関東電化工業	27,100	771.00	20,894,100
SUN A S T E R I S K	10,000	1,080.00	10,800,000
デンカ	50,900	2,578.50	131,245,650
イビデン	73,600	7,002.00	515,347,200
信越化学工業	1,270,600	4,817.00	6,120,480,200
日本カーバイド工業	5,200	1,489.00	7,742,800
プラスアルファ・コンサルティング	8,300	2,653.00	22,019,900
電算システムホールディングス	6,200	2,829.00	17,539,800
堺化学工業	10,700	1,844.00	19,730,800

第一稀元素化学工業	15,300	988.00	15,116,400
エア・ウォーター	132,200	1,965.50	259,839,100
日本酸素ホールディングス	136,000	3,971.00	540,056,000
日本化学工業	5,100	1,989.00	10,143,900
東邦アセチレン	1,700	1,594.00	2,709,800
日本パーカライジング	62,400	1,137.00	70,948,800
高压ガス工業	20,500	789.00	16,174,500
チタン工業	1,000	1,317.00	1,317,000
四国化成ホールディングス	18,000	1,826.00	32,868,000
戸田工業	3,200	1,672.00	5,350,400
ステラ ケミファ	7,600	3,185.00	24,206,000
保土谷化学工業	4,400	3,045.00	13,398,000
日本触媒	21,300	5,318.00	113,273,400
大日精化工業	9,800	2,139.00	20,962,200
カネカ	35,500	3,807.00	135,148,500
協和キリン	169,500	2,440.00	413,580,000
APPIER GROUP	47,900	1,546.00	74,053,400
三菱瓦斯化学	104,600	2,242.50	234,565,500
三井化学	115,500	4,016.00	463,848,000
J S R	152,600	3,988.00	608,568,800
東京応化工業	22,300	8,655.00	193,006,500
大阪有機化学工業	11,700	2,646.00	30,958,200
三菱ケミカルグループ	1,024,200	967.50	990,913,500
KHネオケム	21,400	2,265.00	48,471,000
ダイセル	180,100	1,451.50	261,415,150
住友ベークライト	20,800	6,911.00	143,748,800
積水化学工業	284,100	2,071.00	588,371,100
日本ゼオン	96,100	1,336.50	128,437,650
アイカ工業	35,300	3,370.00	118,961,000
UBE	66,700	2,350.50	156,778,350
積水樹脂	20,900	2,487.00	51,978,300
タキロンシーアイ	35,700	594.00	21,205,800
旭有機材	9,300	3,880.00	36,084,000
ニチバン	7,600	1,759.00	13,368,400
リケンテクノス	30,100	877.00	26,397,700
大倉工業	6,400	2,716.00	17,382,400
積水化成成品工業	19,700	477.00	9,396,900
群栄化学工業	3,300	3,120.00	10,296,000
タイガースポリマー	3,500	793.00	2,775,500
ミライアル	2,600	1,422.00	3,697,200
ダイキアクシス	3,200	733.00	2,345,600
ダイキョーニシカワ	31,000	774.00	23,994,000
竹本容器	3,000	775.00	2,325,000
森六ホールディングス	8,000	2,453.00	19,624,000
恵和	10,100	1,417.00	14,311,700
日本化薬	107,000	1,318.50	141,079,500
カーリットホールディングス	15,100	958.00	14,465,800
ソルクシーズ	6,300	409.00	2,576,700
CLホールディングス	3,400	846.00	2,876,400
プレステージ・インターナショナル	67,300	662.00	44,552,600

フェイス	2,200	494.00	1,086,800
プロトコーポレーション	15,400	1,316.00	20,266,400
ハイマックス	4,400	1,360.00	5,984,000
アミューズ	8,800	1,489.00	13,103,200
野村総合研究所	310,800	4,043.00	1,256,564,400
ドリームインキュベータ	4,900	2,930.00	14,357,000
サイバネットシステム	10,100	1,092.00	11,029,200
クイック	10,000	2,180.00	21,800,000
TAC	3,800	202.00	767,600
CEホールディングス	3,900	572.00	2,230,800
日本システム技術	4,600	2,284.00	10,506,400
電通グループ	141,300	4,491.00	634,578,300
インテージホールディングス	15,900	1,682.00	26,743,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,800	990.00	4,752,000
東邦システムサイエンス	4,600	1,132.00	5,207,200
ぴあ	4,900	3,320.00	16,268,000
イオンファンタジー	5,200	2,788.00	14,497,600
ソースネクスト	64,200	187.00	12,005,400
シーティーエス	18,200	665.00	12,103,000
ネクシィーズグループ	2,500	754.00	1,885,000
インフォコム	18,100	2,481.00	44,906,100
メディカルシステムネットワーク	16,000	507.00	8,112,000
日本精化	9,300	2,756.00	25,630,800
扶桑化学工業	14,900	4,200.00	62,580,000
トリケミカル研究所	17,000	3,335.00	56,695,000
シンプレクス・ホールディングス	21,100	2,419.00	51,040,900
HEROZ	4,700	1,400.00	6,580,000
ラクスル	33,800	1,370.00	46,306,000
メルカリ	85,100	3,279.00	279,042,900
I P S	3,900	2,297.00	8,958,300
F I G	9,100	349.00	3,175,900
システムサポート	5,400	1,991.00	10,751,400
ADEKA	48,800	2,723.50	132,906,800
日油	43,300	6,749.00	292,231,700
ミヨシ油脂	2,900	1,346.00	3,903,400
新日本理化学	10,700	191.00	2,043,700
ハリマ化成グループ	7,600	797.00	6,057,200
イーソル	10,200	681.00	6,946,200
東海ソフト	1,100	1,095.00	1,204,500
ウイングアーク1st	14,500	2,934.00	42,543,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,700	1,247.00	4,613,900
サーバーワークス	2,900	3,230.00	9,367,000
東名	600	1,692.00	1,015,200
ヴィッツ	700	941.00	658,700
トビラシステムズ	2,200	839.00	1,845,800
S a n s a n	45,900	1,364.00	62,607,600
L i n k - U	1,900	745.00	1,415,500
ギフトィ	12,300	1,415.00	17,404,500
花王	316,800	5,636.00	1,785,484,800

第一工業製薬	5,600	1,783.00	9,984,800
石原ケミカル	6,400	2,046.00	13,094,400
日華化学	3,100	956.00	2,963,600
ニイタカ	1,400	2,035.00	2,849,000
三洋化成工業	8,600	4,275.00	36,765,000
メドレー	18,800	4,870.00	91,556,000
ベース	4,800	4,445.00	21,336,000
JMDC	23,900	4,711.00	112,592,900
武田薬品工業	1,241,600	4,131.00	5,129,049,600
アステラス製薬	1,230,600	1,760.50	2,166,471,300
住友ファーマ	104,100	442.00	46,012,200
塩野義製薬	176,900	7,082.00	1,252,805,800
わかもと製薬	8,300	198.00	1,643,400
日本新薬	36,800	5,697.00	209,649,600
中外製薬	439,200	4,720.00	2,073,024,000
科研製薬	24,000	3,209.00	77,016,000
エーザイ	170,700	7,927.00	1,353,138,900
理研ビタミン	11,900	2,280.00	27,132,000
ロート製薬	135,900	3,280.00	445,752,000
小野薬品工業	297,700	2,655.50	790,542,350
久光製薬	31,200	4,656.00	145,267,200
有機合成薬品工業	6,300	284.00	1,789,200
持田製薬	16,100	3,285.00	52,888,500
参天製薬	255,600	1,387.00	354,517,200
扶桑薬品工業	5,000	1,904.00	9,520,000
日本ケミファ	800	1,625.00	1,300,000
ツムラ	44,100	2,802.00	123,568,200
テルモ	391,100	4,224.00	1,652,006,400
H. U. グループホールディングス	42,100	2,459.50	103,544,950
キッセイ薬品工業	23,300	3,060.00	71,298,000
生化学工業	23,800	759.00	18,064,200
栄研化学	27,300	1,510.00	41,223,000
鳥居薬品	7,600	3,590.00	27,284,000
JCRファーマ	47,500	1,212.00	57,570,000
東和薬品	21,500	2,683.00	57,684,500
富士製薬工業	10,400	1,460.00	15,184,000
ゼリア新薬工業	19,400	1,889.00	36,646,600
そーせいグループ	45,200	1,429.00	64,590,800
第一三共	1,222,200	4,090.00	4,998,798,000
杏林製薬	30,400	1,797.00	54,628,800
大幸薬品	28,800	322.00	9,273,600
ダイト	10,800	1,919.00	20,725,200
大塚ホールディングス	291,800	5,528.00	1,613,070,400
大正製薬ホールディングス	31,200	5,497.00	171,506,400
ペプチドリーム	68,000	1,296.50	88,162,000
大日本塗料	15,600	919.00	14,336,400
日本ペイントホールディングス	744,000	1,044.00	776,736,000
関西ペイント	137,300	2,270.00	311,671,000
神東塗料	6,800	122.00	829,600
中国塗料	28,800	1,458.00	41,990,400

日本特殊塗料	5,600	1,169.00	6,546,400
藤倉化成	17,200	454.00	7,808,800
太陽ホールディングス	24,400	2,871.00	70,052,400
D I C	54,700	2,449.50	133,987,650
サカタインクス	31,200	1,341.00	41,839,200
東洋インキＳＣホールディングス	30,400	2,614.00	79,465,600
T&K TOKA	12,100	1,442.00	17,448,200
アルプス技研	13,600	2,715.00	36,924,000
サニックス	23,100	325.00	7,507,500
日本空調サービス	15,600	792.00	12,355,200
オリエンタルランド	761,000	5,089.00	3,872,729,000
フォーカスシステムズ	9,300	971.00	9,030,300
ダスキン	32,000	3,162.00	101,184,000
パーク２４	89,400	1,726.50	154,349,100
明光ネットワークジャパン	17,500	699.00	12,232,500
ファルコホールディングス	6,500	2,028.00	13,182,000
クレスコ	11,500	1,875.00	21,562,500
フジ・メディア・ホールディングス	134,700	1,507.00	202,992,900
秀英予備校	1,900	372.00	706,800
田谷	1,400	412.00	576,800
ラウンドワン	135,200	571.00	77,199,200
リゾートトラスト	62,400	2,192.50	136,812,000
オービック	46,800	22,140.00	1,036,152,000
ジャストシステム	20,200	2,871.00	57,994,200
TDCソフト	13,200	1,765.00	23,298,000
L I N Eヤフー	1,996,900	441.40	881,431,660
ビー・エム・エル	17,700	2,830.00	50,091,000
トレンドマイクロ	66,300	7,085.00	469,735,500
I Dホールディングス	9,500	1,542.00	14,649,000
リソー教育	73,600	237.00	17,443,200
日本オラクル	26,800	10,840.00	290,512,000
早稲田アカデミー	8,000	1,529.00	12,232,000
アルファシステムズ	3,600	2,921.00	10,515,600
フューチャー	29,900	1,777.00	53,132,300
C A C H o l d i n g s	7,600	1,725.00	13,110,000
S Bテクノロジー	5,900	2,382.00	14,053,800
トーセ	2,200	707.00	1,555,400
ユー・エス・エス	161,300	2,874.50	463,656,850
オービックビジネスコンサルタント	19,700	6,512.00	128,286,400
アイティフォー	18,000	1,073.00	19,314,000
東京個別指導学院	17,100	484.00	8,276,400
東計電算	2,000	6,600.00	13,200,000
サイバーエージェント	317,700	800.80	254,414,160
楽天グループ	1,231,500	552.50	680,403,750
エックスネット	1,000	1,057.00	1,057,000
クリーク・アンド・リバー社	7,300	1,999.00	14,592,700
S B I グローバルアセットマネジメン ト	28,300	557.00	15,763,100
テー・オー・ダブリュー	28,300	313.00	8,857,900
大塚商会	69,600	5,914.00	411,614,400

サイボウズ	19,300	2,025.00	39,082,500
山田コンサルティンググループ	6,200	1,679.00	10,409,800
セントラルスポーツ	5,400	2,440.00	13,176,000
パラカ	4,900	1,965.00	9,628,500
電通国際情報サービス	17,000	4,570.00	77,690,000
ACCESS	14,500	757.00	10,976,500
デジタルガレージ	22,400	2,990.00	66,976,000
イーエムシステムズ	23,400	679.00	15,888,600
ウェザーニューズ	4,400	5,920.00	26,048,000
C I J	23,300	599.00	13,956,700
ビジネスエンジニアリング	2,300	3,750.00	8,625,000
日本エンタープライズ	8,100	118.00	955,800
WOWOW	10,600	1,050.00	11,130,000
スカラ	13,000	766.00	9,958,000
インテリジェント ウェイブ	4,200	968.00	4,065,600
フルキャストホールディングス	13,700	1,837.00	25,166,900
エン・ジャパン	23,400	2,251.00	52,673,400
あすか製薬ホールディングス	14,300	1,857.00	26,555,100
サワイグループホールディングス	32,100	4,994.00	160,307,400
富士フイルムホールディングス	260,300	8,470.00	2,204,741,000
コニカミノルタ	315,500	461.00	145,445,500
資生堂	292,900	4,185.00	1,225,786,500
ライオン	183,600	1,300.00	238,680,000
高砂香料工業	10,500	3,445.00	36,172,500
マンダム	30,300	1,253.00	37,965,900
ミルボン	19,000	3,768.00	71,592,000
ファンケル	61,400	2,156.00	132,378,400
コーセー	28,600	9,911.00	283,454,600
コタ	12,900	1,550.00	19,995,000
シーボン	1,100	1,485.00	1,633,500
ポーラ・オルビスホールディングス	71,900	1,503.00	108,065,700
ノエビアホールディングス	12,500	5,240.00	65,500,000
アジュバンホールディングス	2,000	918.00	1,836,000
新日本製薬	8,000	1,548.00	12,384,000
I-n e	2,800	2,798.00	7,834,400
アクシージア	7,200	942.00	6,782,400
エステー	10,800	1,496.00	16,156,800
アグロ カネショウ	5,600	1,334.00	7,470,400
コニシ	23,500	2,490.00	58,515,000
長谷川香料	26,800	3,295.00	88,306,000
小林製薬	40,800	6,625.00	270,300,000
荒川化学工業	11,800	1,010.00	11,918,000
メック	11,500	4,115.00	47,322,500
日本高純度化学	3,200	2,573.00	8,233,600
タカラバイオ	37,800	1,164.00	43,999,200
J C U	15,700	3,535.00	55,499,500
新田ゼラチン	5,300	711.00	3,768,300
O A Tアグリオ	4,100	1,944.00	7,970,400
デクセリアルズ	35,200	4,300.00	151,360,000
アース製薬	12,800	4,785.00	61,248,000

北興化学工業	14,100	917.00	12,929,700
大成ラミック	4,100	2,990.00	12,259,000
クミアイ化学工業	55,700	1,100.00	61,270,000
日本農薬	25,800	594.00	15,325,200
富士興産	2,300	1,844.00	4,241,200
ニチレキ	18,300	2,411.00	44,121,300
ユシロ化学工業	7,300	1,665.00	12,154,500
ビーピー・カストロール	3,000	890.00	2,670,000
富士石油	40,900	350.00	14,315,000
MORESCO	2,800	1,254.00	3,511,200
出光興産	155,800	3,430.00	534,394,000
ENEOSホールディングス	2,221,100	547.20	1,215,385,920
コスモエネルギーホールディングス	41,500	5,758.00	238,957,000
ANYCOLOR	4,900	3,625.00	17,762,500
テスホールディングス	29,600	448.00	13,260,800
インフロニア・ホールディングス	158,100	1,587.50	250,983,750
横浜ゴム	70,900	3,148.00	223,193,200
TOYO TIRE	80,600	2,329.50	187,757,700
ブリヂストン	410,700	5,816.00	2,388,631,200
住友ゴム工業	137,500	1,816.50	249,768,750
藤倉コンポジット	9,500	1,358.00	12,901,000
オカモト	6,600	5,380.00	35,508,000
アキレス	8,800	1,584.00	13,939,200
フコク	7,400	1,330.00	9,842,000
ニッタ	14,200	3,680.00	52,256,000
クリエートメディック	2,500	882.00	2,205,000
住友理工	21,800	1,024.00	22,323,200
三ツ星ベルト	17,000	4,355.00	74,035,000
バンドー化学	20,800	1,596.00	33,196,800
AGC	130,900	5,268.00	689,581,200
日本板硝子	66,900	636.00	42,548,400
石塚硝子	1,400	3,145.00	4,403,000
有沢製作所	24,500	1,038.00	25,431,000
日本山村硝子	2,900	1,644.00	4,767,600
日本電気硝子	57,200	2,998.50	171,514,200
オハラ	6,600	1,296.00	8,553,600
住友大阪セメント	23,400	3,683.00	86,182,200
太平洋セメント	83,000	2,827.00	234,641,000
リソルホールディングス	700	5,190.00	3,633,000
日本ヒューム	12,300	892.00	10,971,600
日本コンクリート工業	27,300	335.00	9,145,500
三谷セキサン	5,800	4,325.00	25,085,000
アジアパイルホールディングス	19,900	651.00	12,954,900
東海カーボン	129,400	1,075.50	139,169,700
日本カーボン	7,500	4,520.00	33,900,000
東洋炭素	9,900	4,460.00	44,154,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,800	6,630.00	51,714,000
TOTO	92,500	3,871.00	358,067,500
日本碍子	163,200	1,904.00	310,732,800
日本特殊陶業	117,500	3,399.00	399,382,500

ダントーホールディングス	5,200	839.00	4,362,800
MARUWA	5,200	27,870.00	144,924,000
品川リフラクトリーズ	17,200	1,588.00	27,313,600
黒崎播磨	2,900	10,130.00	29,377,000
ヨータイ	8,700	1,421.00	12,362,700
東京窯業	8,500	334.00	2,839,000
ニッカトー	3,500	555.00	1,942,500
フジインコーポレーテッド	37,700	3,040.00	114,608,000
クミネ工業	2,300	969.00	2,228,700
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,163.00	1,977,100
ニチアス	35,400	3,135.00	110,979,000
日本製鉄	646,300	3,274.00	2,115,986,200
神戸製鋼所	290,200	1,725.50	500,740,100
中山製鋼所	33,000	809.00	26,697,000
合同製鐵	8,100	4,380.00	35,478,000
JFEホールディングス	401,400	2,158.00	866,221,200
東京製鐵	40,600	1,790.00	72,674,000
共英製鋼	16,500	2,146.00	35,409,000
大和工業	27,200	7,309.00	198,804,800
東京鐵鋼	6,300	3,725.00	23,467,500
大阪製鐵	6,800	1,855.00	12,614,000
淀川製鋼所	16,400	3,770.00	61,828,000
中部鋼鈑	9,500	1,979.00	18,800,500
丸一鋼管	43,900	3,817.00	167,566,300
モリ工業	2,600	4,350.00	11,310,000
大同特殊鋼	18,200	6,202.00	112,876,400
日本高周波鋼業	3,100	513.00	1,590,300
日本冶金工業	10,600	4,085.00	43,301,000
山陽特殊製鋼	14,300	2,519.00	36,021,700
愛知製鋼	8,300	3,465.00	28,759,500
日本金属	2,200	803.00	1,766,600
ミガロホールディングス	1,100	1,165.00	1,281,500
大平洋金属	12,400	1,335.00	16,554,000
新日本電工	72,000	273.00	19,656,000
栗本鐵工所	6,800	3,065.00	20,842,000
虹 技	1,000	1,123.00	1,123,000
日本鑄鐵管	800	1,036.00	828,800
日本製鋼所	39,000	2,494.00	97,266,000
三菱製鋼	10,700	1,494.00	15,985,800
日亜鋼業	8,600	303.00	2,605,800
日本精線	2,100	4,775.00	10,027,500
エンビプロ・ホールディングス	7,700	630.00	4,851,000
大紀アルミニウム工業所	18,300	1,206.00	22,069,800
日本輕金属ホールディングス	42,200	1,631.00	68,828,200
三井金属鈹業	42,000	4,208.00	176,736,000
東邦亜鉛	9,200	1,170.00	10,764,000
三菱マテリアル	103,200	2,417.50	249,486,000
住友金属鈹山	167,300	4,177.00	698,812,100
DOWAホールディングス	35,600	5,030.00	179,068,000
古河機械金属	19,100	1,976.00	37,741,600

エス・サイエンス	49,500	23.00	1,138,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	25,000	2,972.00	74,300,000
東邦チタニウム	29,800	1,814.00	54,057,200
UACJ	20,300	3,120.00	63,336,000
CKサンエツ	2,700	3,605.00	9,733,500
古河電気工業	48,000	2,294.50	110,136,000
住友電気工業	539,900	1,816.00	980,458,400
フジクラ	170,200	1,074.50	182,879,900
SWCC	16,100	2,512.00	40,443,200
タツタ電線	25,700	687.00	17,655,900
カナレ電気	1,400	1,491.00	2,087,400
平河ビューテック	9,200	1,416.00	13,027,200
いよぎんホールディングス	163,900	998.00	163,572,200
しずおかフィナンシャルグループ	306,100	1,218.50	372,982,850
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	116,000	1,097.00	127,252,000
楽天銀行	47,900	2,424.00	116,109,600
京都フィナンシャルグループ	43,600	8,263.00	360,266,800
リョービ	15,400	2,954.00	45,491,600
アーレスティ	8,800	763.00	6,714,400
AREホールディングス	54,300	1,872.00	101,649,600
東洋製罐グループホールディングス	86,100	2,391.50	205,908,150
ホッカンホールディングス	7,100	1,622.00	11,516,200
コロナ	8,100	903.00	7,314,300
横河ブリッジホールディングス	22,500	2,606.00	58,635,000
駒井ハルテック	1,500	2,177.00	3,265,500
高田機工	600	3,060.00	1,836,000
三和ホールディングス	145,000	2,152.50	312,112,500
文化シャッター	37,700	1,361.00	51,309,700
三協立山	16,500	834.00	13,761,000
アルインコ	11,000	995.00	10,945,000
東洋シャッター	1,900	667.00	1,267,300
LIXIL	225,300	1,754.50	395,288,850
日本フィルコン	5,200	484.00	2,516,800
ノーリツ	23,900	1,521.00	36,351,900
長府製作所	14,300	2,098.00	30,001,400
リンナイ	70,600	2,843.00	200,715,800
ユニプレス	25,100	951.00	23,870,100
ダイニチ工業	4,200	708.00	2,973,600
日東精工	21,000	588.00	12,348,000
三洋工業	900	2,199.00	1,979,100
岡部	25,800	691.00	17,827,800
ジーテクト	18,400	1,746.00	32,126,400
東プレ	25,400	1,646.00	41,808,400
高周波熱錬	22,200	994.00	22,066,800
東京製綱	9,300	1,407.00	13,085,100
サンコール	11,200	472.00	5,286,400
モリテックスチール	7,200	304.00	2,188,800
パイオラックス	17,900	2,278.00	40,776,200
エイチワン	14,900	802.00	11,949,800
日本発条	127,700	1,161.00	148,259,700

中央発條	10,700	713.00	7,629,100
アドバネクス	900	916.00	824,400
三浦工業	59,000	2,848.00	168,032,000
タクマ	47,800	1,512.00	72,273,600
テクノプロ・ホールディングス	85,100	3,248.00	276,404,800
アトラグループ	2,400	207.00	496,800
アイ・アールジャパンホールディングス	7,500	1,427.00	10,702,500
Ke e P e r 技研	8,800	5,750.00	50,600,000
ファーストロジック	1,900	496.00	942,400
三機サービス	1,200	1,088.00	1,305,600
G u n o s y	11,400	666.00	7,592,400
デザインワン・ジャパン	2,100	160.00	336,000
イー・ガーディアン	5,400	1,521.00	8,213,400
リブセンス	3,700	278.00	1,028,600
ジャパンマテリアル	44,000	2,268.00	99,792,000
ベクトル	17,700	1,083.00	19,169,100
ウチヤマホールディングス	3,400	353.00	1,200,200
チャーム・ケア・コーポレーション	11,900	1,171.00	13,934,900
キャリアリンク	5,300	2,078.00	11,013,400
I B J	11,000	694.00	7,634,000
アサンテ	7,200	1,570.00	11,304,000
バリューHR	12,600	1,301.00	16,392,600
M&Aキャピタルパートナーズ	11,600	2,093.00	24,278,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,700	1,023.00	5,831,100
E R I ホールディングス	2,100	1,697.00	3,563,700
アビスト	1,200	3,075.00	3,690,000
シグマクシス・ホールディングス	19,400	1,251.00	24,269,400
ウィルグループ	11,900	1,084.00	12,899,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	9,800	141.00	1,381,800
メドピア	12,700	1,063.00	13,500,100
レアジョブ	1,600	945.00	1,512,000
リクルートホールディングス	1,064,600	4,500.00	4,790,700,000
エラン	19,000	900.00	17,100,000
ツガミ	31,400	1,103.00	34,634,200
オークマ	12,400	6,324.00	78,417,600
芝浦機械	14,100	3,495.00	49,279,500
アマダ	225,400	1,454.50	327,844,300
アイダエンジニアリング	32,700	942.00	30,803,400
TAKI SAWA	2,400	2,592.00	6,220,800
F U J I	66,500	2,383.00	158,469,500
牧野フライス製作所	15,600	5,710.00	89,076,000
オーエスジー	62,200	1,768.00	109,969,600
ダイジェット工業	800	872.00	697,600
旭ダイヤモンド工業	33,900	885.00	30,001,500
DMG森精機	85,600	2,610.50	223,458,800
ソディック	34,300	764.00	26,205,200
ディスコ	68,000	29,605.00	2,013,140,000
日東工器	6,900	1,818.00	12,544,200

日進工具	13,100	1,023.00	13,401,300
パンチ工業	7,700	423.00	3,257,100
富士ダイス	7,400	652.00	4,824,800
土木管理総合試験所	3,600	318.00	1,144,800
日本郵政	1,689,800	1,305.00	2,205,189,000
ベルシステム24ホールディングス	15,400	1,654.00	25,471,600
鎌倉新書	12,300	596.00	7,330,800
SMN	1,500	300.00	450,000
一蔵	1,000	572.00	572,000
グローバルキッズCOMPANY	1,500	626.00	939,000
エアトリ	10,500	1,896.00	19,908,000
アトラエ	8,500	961.00	8,168,500
ストライク	6,100	3,485.00	21,258,500
ソラスト	39,700	569.00	22,589,300
セラク	4,400	1,232.00	5,420,800
インソース	31,200	1,019.00	31,792,800
豊田自動織機	119,300	11,805.00	1,408,336,500
豊和工業	4,300	753.00	3,237,900
石川製作所	2,000	1,198.00	2,396,000
リケンNPR	15,400	1,887.00	29,059,800
東洋機械金属	6,400	641.00	4,102,400
津田駒工業	1,500	371.00	556,500
エンシュウ	1,900	676.00	1,284,400
島精機製作所	22,500	1,578.00	35,505,000
オプトラン	23,300	1,797.00	41,870,100
NCホールディングス	1,900	1,771.00	3,364,900
イワキ	9,500	1,815.00	17,242,500
フリー	13,300	1,553.00	20,654,900
ヤマシンフィルタ	34,000	312.00	10,608,000
日阪製作所	15,400	962.00	14,814,800
やまびこ	23,100	1,413.00	32,640,300
野村マイクロ・サイエンス	4,800	8,570.00	41,136,000
平田機工	6,800	6,180.00	42,024,000
PEGASUS	15,600	458.00	7,144,800
マルマエ	6,100	1,413.00	8,619,300
タツモ	8,500	2,906.00	24,701,000
ナブテスコ	88,600	2,715.50	240,593,300
三井海洋開発	17,900	1,899.00	33,992,100
レオン自動機	16,300	1,532.00	24,971,600
SMC	42,300	76,070.00	3,217,761,000
ホソカワミクロン	9,000	4,005.00	36,045,000
ユニオンツール	6,200	3,465.00	21,483,000
瑞光	10,200	1,436.00	14,647,200
オイレス工業	19,100	1,974.00	37,703,400
日精エー・エス・ビー機械	5,600	5,020.00	28,112,000
サトーホールディングス	20,000	2,099.00	41,980,000
技研製作所	13,300	1,810.00	24,073,000
日本エアータック	6,500	1,385.00	9,002,500
カワタ	2,500	1,039.00	2,597,500
日精樹脂工業	10,500	1,031.00	10,825,500

オカダアイヨン	2,600	2,249.00	5,847,400
ワイエイシイホールディングス	4,700	2,276.00	10,697,200
小松製作所	662,200	3,670.00	2,430,274,000
住友重機械工業	83,600	3,362.00	281,063,200
日立建機	56,300	4,016.00	226,100,800
日工	21,000	668.00	14,028,000
巴工業	5,500	2,801.00	15,405,500
井関農機	13,200	1,092.00	14,414,400
TOWA	15,700	5,720.00	89,804,000
丸山製作所	1,400	2,056.00	2,878,400
北川鉄工所	5,600	1,304.00	7,302,400
シンニッタン	10,200	245.00	2,499,000
ローツェ	7,400	12,630.00	93,462,000
タカキタ	2,600	451.00	1,172,600
クボタ	741,300	2,060.50	1,527,448,650
荏原実業	7,500	2,770.00	20,775,000
東洋エンジニアリング	20,200	685.00	13,837,000
三菱化工機	5,000	2,964.00	14,820,000
月島ホールディングス	19,100	1,273.00	24,314,300
帝国電機製作所	10,000	2,745.00	27,450,000
東京機械製作所	2,100	455.00	955,500
新東工業	28,600	1,037.00	29,658,200
澁谷工業	13,300	2,480.00	32,984,000
アイチコーポレーション	19,700	901.00	17,749,700
小森コーポレーション	35,700	1,168.00	41,697,600
鶴見製作所	10,800	3,855.00	41,634,000
日本ギア工業	3,000	466.00	1,398,000
酒井重工業	2,000	5,780.00	11,560,000
荏原製作所	58,000	7,163.00	415,454,000
石井鐵工所	900	2,745.00	2,470,500
西島製作所	12,200	1,857.00	22,655,400
北越工業	14,200	1,944.00	27,604,800
ダイキン工業	168,700	23,165.00	3,907,935,500
オルガノ	16,900	5,500.00	92,950,000
トーヨーカネツ	5,400	3,425.00	18,495,000
栗田工業	79,000	4,916.00	388,364,000
樺本チエイン	20,000	3,750.00	75,000,000
大同工業	3,400	717.00	2,437,800
日機装	32,500	957.00	31,102,500
木村化工機	10,800	735.00	7,938,000
レイズネクスト	19,800	1,386.00	27,442,800
アネスト岩田	21,800	1,100.00	23,980,000
ダイフク	238,400	2,588.00	616,979,200
サムコ	3,700	4,295.00	15,891,500
加藤製作所	3,900	1,137.00	4,434,300
油研工業	1,200	2,064.00	2,476,800
タダノ	81,300	1,154.00	93,820,200
フジテック	33,000	3,503.00	115,599,000
CKD	39,100	2,113.00	82,618,300
平和	41,800	2,041.00	85,313,800

理想科学工業	11,300	2,646.00	29,899,800
SANKYO	34,700	6,387.00	221,628,900
日本金銭機械	17,000	1,080.00	18,360,000
マースグループホールディングス	7,200	2,367.00	17,042,400
フクシマガリレイ	9,200	4,700.00	43,240,000
オーイズミ	2,900	361.00	1,046,900
ダイコク電機	7,000	4,020.00	28,140,000
竹内製作所	25,700	4,340.00	111,538,000
アマノ	40,100	3,126.00	125,352,600
JUKI	21,900	500.00	10,950,000
サンデン	11,800	171.00	2,017,800
ジャノメ	14,300	712.00	10,181,600
ブラザー工業	188,700	2,466.00	465,334,200
マックス	19,900	2,744.00	54,605,600
モリタホールディングス	24,500	1,530.00	37,485,000
グローリー	33,900	2,693.50	91,309,650
新晃工業	14,200	2,620.00	37,204,000
大和冷機工業	21,600	1,370.00	29,592,000
セガサミーホールディングス	126,200	2,176.50	274,674,300
T P R	18,000	1,777.00	31,986,000
ツバキ・ナカシマ	28,400	750.00	21,300,000
ホシザキ	83,400	4,783.00	398,902,200
大豊工業	12,300	853.00	10,491,900
日本精工	261,500	794.50	207,761,750
NTN	306,300	277.70	85,059,510
ジェイテクト	125,700	1,371.00	172,334,700
不二越	10,400	3,860.00	40,144,000
ミネベアミツミ	245,800	2,600.00	639,080,000
日本トムソン	38,400	555.00	21,312,000
THK	81,500	2,895.00	235,942,500
ユーシン精機	11,200	659.00	7,380,800
前澤給装工業	10,800	1,400.00	15,120,000
イーグル工業	15,600	1,592.00	24,835,200
前澤工業	4,500	942.00	4,239,000
日本ピラー工業	13,100	4,220.00	55,282,000
キッツ	47,300	1,108.00	52,408,400
日立製作所	687,100	10,055.00	6,908,790,500
東芝	113,300	4,601.00	521,293,300
三菱電機	1,572,400	1,956.50	3,076,400,600
富士電機	85,900	6,147.00	528,027,300
東洋電機製造	2,500	902.00	2,255,000
安川電機	153,400	5,503.00	844,160,200
シンフォニア テクノロジー	15,600	1,826.00	28,485,600
明電舎	26,200	2,393.00	62,696,600
オリジン	1,800	1,160.00	2,088,000
山洋電気	6,100	5,880.00	35,868,000
デンヨー	10,800	2,226.00	24,040,800
PHCホールディングス	26,400	1,371.00	36,194,400
ソシオネクスト	20,500	13,990.00	286,795,000
ベイカレント・コンサルティング	105,600	4,322.00	456,403,200

Orchestra Holdings	3,100	977.00	3,028,700
アイモバイル	19,000	477.00	9,063,000
キャリアインデックス	2,700	248.00	669,600
MS-Japan	4,600	1,150.00	5,290,000
船場	1,700	935.00	1,589,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	46,600	2,207.00	102,846,200
フルテック	1,100	1,193.00	1,312,300
グリーンズ	2,900	1,495.00	4,335,500
ツナググループ・ホールディングス	2,300	743.00	1,708,900
GAMEWITH	2,400	326.00	782,400
MS&Consulting	1,000	667.00	667,000
ウェルビー	7,200	678.00	4,881,600
エル・ティール・エス	1,700	3,210.00	5,457,000
ミダックホールディングス	8,700	1,733.00	15,077,100
キュービーネットホールディングス	6,900	1,616.00	11,150,400
RPAホールディングス	19,500	284.00	5,538,000
三櫻工業	21,400	923.00	19,752,200
マキタ	161,100	3,691.00	594,620,100
東芝テック	18,100	3,065.00	55,476,500
芝浦メカトロニクス	8,000	7,310.00	58,480,000
マブチモーター	35,100	4,492.00	157,669,200
ニデック	311,900	5,638.00	1,758,492,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,900	434.00	3,862,600
トレックス・セミコンダクター	7,300	1,954.00	14,264,200
東光高岳	8,500	2,026.00	17,221,000
ダブル・スコープ	40,400	866.00	34,986,400
宮越ホールディングス	6,300	1,122.00	7,068,600
ダイヘン	14,100	5,380.00	75,858,000
ヤーマン	24,400	1,032.00	25,180,800
JVCケンウッド	111,500	636.00	70,914,000
ミマキエンジニアリング	13,400	753.00	10,090,200
I-PEX	9,800	1,610.00	15,778,000
大崎電気工業	31,000	632.00	19,592,000
オムロン	107,900	5,895.00	636,070,500
日東工業	19,000	3,435.00	65,265,000
IDEC	20,900	2,797.00	58,457,300
正興電機製作所	2,600	1,114.00	2,896,400
不二電機工業	1,600	1,124.00	1,798,400
ジーエス・ユアサコーポレーション	46,300	2,499.00	115,703,700
サクサホールディングス	1,800	2,304.00	4,147,200
メルコホールディングス	4,500	3,515.00	15,817,500
テクノメディカ	3,400	2,429.00	8,258,600
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,300	828.00	4,388,400
日本電気	185,500	7,665.00	1,421,857,500
富士通	130,000	19,455.00	2,529,150,000
沖電気工業	63,800	945.00	60,291,000
岩崎通信機	3,700	753.00	2,786,100

電気興業	6,300	2,416.00	15,220,800
サンケン電気	13,100	7,104.00	93,062,400
ナカヨ	1,200	1,204.00	1,444,800
アイホン	7,700	2,843.00	21,891,100
ルネサスエレクトロニクス	922,000	2,214.00	2,041,308,000
セイコーエプソン	181,300	2,163.50	392,242,550
ワコム	107,400	693.00	74,428,200
アルバック	33,600	6,291.00	211,377,600
アクセル	4,900	1,783.00	8,736,700
E I Z O	10,400	4,850.00	50,440,000
ジャパンディスプレイ	609,100	33.00	20,100,300
日本信号	32,200	954.00	30,718,800
京三製作所	29,600	495.00	14,652,000
能美防災	19,100	1,838.00	35,105,800
ホーチキ	10,600	1,713.00	18,157,800
星和電機	3,400	490.00	1,666,000
エレコム	33,800	1,684.00	56,919,200
パナソニック ホールディングス	1,668,900	1,392.00	2,323,108,800
シャープ	238,200	921.40	219,477,480
アンリツ	99,500	1,203.00	119,698,500
富士通ゼネラル	40,000	2,565.00	102,600,000
ソニーグループ	989,500	12,655.00	12,522,122,500
TDK	223,700	6,330.00	1,416,021,000
帝国通信工業	6,100	1,991.00	12,145,100
タムラ製作所	56,300	555.00	31,246,500
アルプスアルパイン	126,100	1,211.50	152,770,150
池上通信機	2,500	822.00	2,055,000
日本電波工業	16,900	1,165.00	19,688,500
鈴木	7,600	1,167.00	8,869,200
メイコー	14,000	4,290.00	60,060,000
日本トリム	3,200	3,030.00	9,696,000
ローランド ディー. ジー.	7,700	3,445.00	26,526,500
フォスター電機	10,500	895.00	9,397,500
SMK	3,700	2,428.00	8,983,600
ヨコオ	12,500	1,411.00	17,637,500
ティアック	12,600	100.00	1,260,000
ホシデン	32,100	1,712.00	54,955,200
ヒロセ電機	20,900	16,250.00	339,625,000
日本航空電子工業	33,800	2,850.00	96,330,000
TOA	16,100	1,043.00	16,792,300
マクセル	31,200	1,667.00	52,010,400
古野電気	18,400	1,753.00	32,255,200
スミダコーポレーション	18,900	1,124.00	21,243,600
アイコム	5,400	3,165.00	17,091,000
リオン	5,800	2,178.00	12,632,400
横河電機	154,600	2,960.00	457,616,000
新電元工業	5,400	2,925.00	15,795,000
アズビル	97,700	4,896.00	478,339,200
東亜ディーケーケー	3,600	899.00	3,236,400
日本光電工業	60,000	3,696.00	221,760,000

チノー	5,800	2,127.00	12,336,600
共和電業	7,300	396.00	2,890,800
日本電子材料	8,600	1,382.00	11,885,200
堀場製作所	26,700	8,028.00	214,347,600
アドバンテスト	400,700	4,306.00	1,725,414,200
小野測器	3,200	434.00	1,388,800
エスベック	11,200	2,196.00	24,595,200
キーエンス	139,900	59,490.00	8,322,651,000
日置電機	6,600	6,480.00	42,768,000
シスメックス	120,700	7,587.00	915,750,900
日本マイクロニクス	25,100	2,603.00	65,335,300
メガチップス	11,000	3,860.00	42,460,000
OBARA GROUP	7,700	3,595.00	27,681,500
IMAGICA GROUP	14,000	635.00	8,890,000
澤藤電機	900	1,239.00	1,115,100
デンソー	1,154,100	2,339.00	2,699,439,900
原田工業	3,400	780.00	2,652,000
コーセル	16,800	1,213.00	20,378,400
イリソ電子工業	12,900	3,810.00	49,149,000
オブテックスグループ	25,700	1,701.00	43,715,700
千代田インテグレ	5,500	2,940.00	16,170,000
レーザーテック	64,100	29,060.00	1,862,746,000
スタンレー電気	89,500	2,572.00	230,194,000
ウシオ電機	71,000	1,889.50	134,154,500
岡谷電機産業	6,000	282.00	1,692,000
ヘリオス テクノ ホールディング	7,800	485.00	3,783,000
エノモト	2,200	1,515.00	3,333,000
日本セラミック	11,400	2,764.00	31,509,600
遠藤照明	3,400	1,153.00	3,920,200
古河電池	10,300	926.00	9,537,800
双信電機	3,100	317.00	982,700
山一電機	12,600	1,766.00	22,251,600
図研	12,200	3,945.00	48,129,000
日本電子	35,000	5,539.00	193,865,000
カシオ計算機	101,100	1,243.50	125,717,850
ファナック	682,100	3,829.00	2,611,760,900
日本シイエムケイ	29,700	710.00	21,087,000
エンプラス	4,100	10,060.00	41,246,000
大真空	20,800	741.00	15,412,800
ローム	258,600	2,530.00	654,258,000
浜松ホトニクス	112,300	5,886.00	660,997,800
三井ハイテック	12,400	6,803.00	84,357,200
新光電気工業	49,400	5,275.00	260,585,000
京セラ	217,300	7,904.00	1,717,539,200
協栄産業	800	2,328.00	1,862,400
太陽誘電	68,100	3,854.00	262,457,400
村田製作所	1,272,600	2,911.00	3,704,538,600
双葉電子工業	26,700	526.00	14,044,200
日東電工	90,200	10,400.00	938,080,000
北陸電気工業	2,900	1,357.00	3,935,300

東海理化電機製作所	39,500	2,443.00	96,498,500
ニチコン	36,700	1,406.00	51,600,200
日本ケミコン	14,900	1,402.00	20,889,800
KOA	21,200	1,508.00	31,969,600
三井E&S	66,800	485.00	32,398,000
日立造船	124,600	846.00	105,411,600
三菱重工業	247,100	8,208.00	2,028,196,800
川崎重工業	114,200	3,286.00	375,261,200
IHI	105,200	2,819.50	296,611,400
名村造船所	30,400	1,106.00	33,622,400
サノヤスホールディングス	11,500	135.00	1,552,500
スプリックス	2,300	802.00	1,844,600
マネジメントソリューションズ	6,100	2,797.00	17,061,700
プロレド・パートナーズ	3,400	374.00	1,271,600
and factory	2,400	320.00	768,000
テノ.ホールディングス	900	485.00	436,500
フロンティア・マネジメント	3,600	1,650.00	5,940,000
ピアラ	1,600	397.00	635,200
コプロ・ホールディングス	2,600	1,214.00	3,156,400
ギークス	1,000	548.00	548,000
アンビスホールディングス	15,400	2,848.00	43,859,200
カーブスホールディングス	39,300	648.00	25,466,400
フォーラムエンジニアリング	9,800	1,467.00	14,376,600
FAST FITNESS JAPAN	4,900	1,246.00	6,105,400
日本車輛製造	4,600	2,079.00	9,563,400
三菱ロジスネクスト	22,300	1,265.00	28,209,500
近畿車輛	1,000	1,892.00	1,892,000
一家ホールディングス	2,100	656.00	1,377,600
フルサト・マルカホールディングス	13,200	2,803.00	36,999,600
ヤマエグループホールディングス	8,400	3,570.00	29,988,000
ジャパングラフトホールディングス	4,800	182.00	873,600
FPG	46,600	1,483.00	69,107,800
島根銀行	2,200	525.00	1,155,000
じもとホールディングス	6,800	500.00	3,400,000
全国保証	36,000	4,792.00	172,512,000
めぶきフィナンシャルグループ	683,600	436.60	298,459,760
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,300	1,623.00	18,339,900
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,700	4,300.00	76,110,000
九州フィナンシャルグループ	266,600	847.30	225,890,180
かんぽ生命保険	140,300	2,801.50	393,050,450
ゆうちょ銀行	1,513,800	1,393.00	2,108,723,400
あんしん保証	3,400	262.00	890,800
富山第一銀行	43,700	893.00	39,024,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	739,100	678.70	501,627,170
ジェイリース	3,600	1,923.00	6,922,800
西日本フィナンシャルホールディングス	77,700	1,772.00	137,684,400

イントラスト	2,900	818.00	2,372,200
日本モーゲージサービス	4,300	524.00	2,253,200
CASA	3,000	830.00	2,490,000
アルヒ	13,200	817.00	10,784,400
プレミアグループ	23,200	1,652.00	38,326,400
日産自動車	1,987,100	583.80	1,160,068,980
いすゞ自動車	406,700	1,865.00	758,495,500
トヨタ自動車	7,680,800	2,817.00	21,636,813,600
日野自動車	210,300	467.90	98,399,370
三菱自動車工業	545,700	494.10	269,630,370
エフテック	5,400	609.00	3,288,600
レシップホールディングス	3,400	558.00	1,897,200
GMB	1,600	1,496.00	2,393,600
ファルテック	1,500	548.00	822,000
武蔵精密工業	34,200	1,642.00	56,156,400
日産車体	16,500	782.00	12,903,000
新明和工業	40,300	1,202.00	48,440,600
極東開発工業	23,100	1,907.00	44,051,700
トピー工業	11,300	2,670.00	30,171,000
ティラド	3,100	3,105.00	9,625,500
曙ブレーキ工業	85,500	125.00	10,687,500
タチエス	25,800	1,679.00	43,318,200
NOK	54,300	1,934.50	105,043,350
フタバ産業	37,400	766.00	28,648,400
カヤバ	13,500	4,345.00	58,657,500
市光工業	25,100	562.00	14,106,200
大同メタル工業	27,300	572.00	15,615,600
プレス工業	55,800	606.00	33,814,800
ミクニ	9,800	437.00	4,282,600
太平洋工業	32,100	1,395.00	44,779,500
河西工業	12,400	245.00	3,038,000
アイシン	107,900	5,487.00	592,047,300
マツダ	462,600	1,674.50	774,623,700
今仙電機製作所	5,000	567.00	2,835,000
本田技研工業	3,411,100	1,563.50	5,333,254,850
スズキ	256,900	6,479.00	1,664,455,100
SUBARU	442,600	2,718.00	1,202,986,800
安永	3,400	700.00	2,380,000
ヤマハ発動機	201,500	3,660.00	737,490,000
小糸製作所	151,400	2,329.50	352,686,300
TBK	8,500	386.00	3,281,000
エクセディ	22,900	2,557.00	58,555,300
ミツバ	26,200	851.00	22,296,200
豊田合成	40,800	3,094.00	126,235,200
愛三工業	23,200	1,275.00	29,580,000
盟和産業	1,100	983.00	1,081,300
日本プラスト	6,500	604.00	3,926,000
ヨロズ	13,100	892.00	11,685,200
エフ・シー・シー	24,700	1,802.00	44,509,400
新家工業	1,800	2,954.00	5,317,200

シマノ	56,800	22,225.00	1,262,380,000
テイ・エス テック	49,800	1,784.00	88,843,200
三十三フィナンシャルグループ	12,400	1,836.00	22,766,400
第四北越フィナンシャルグループ	21,600	3,810.00	82,296,000
ひろぎんホールディングス	196,100	956.40	187,550,040
マーキュリアホールディングス	3,900	773.00	3,014,700
おきなわフィナンシャルグループ	11,700	2,475.00	28,957,500
ダイレクトマーケティングミックス	14,900	462.00	6,883,800
ポピンズ	2,200	1,459.00	3,209,800
LITALICO	11,200	2,072.00	23,206,400
コンフィデンス・インターワークス	500	1,483.00	741,500
十六フィナンシャルグループ	17,900	3,820.00	68,378,000
北國フィナンシャルホールディングス	14,500	4,615.00	66,917,500
ネットプロテクションズホールディングス	45,600	281.00	12,813,600
プロクレアホールディングス	15,800	1,908.00	30,146,400
F P パートナー	2,700	4,055.00	10,948,500
あいちフィナンシャルグループ	21,200	2,330.00	49,396,000
ジャムコ	5,900	1,467.00	8,655,300
小野建	14,600	1,687.00	24,630,200
はるやまホールディングス	3,900	527.00	2,055,300
南陽	1,700	2,037.00	3,462,900
ノジマ	42,900	1,404.00	60,231,600
佐鳥電機	7,300	1,871.00	13,658,300
カッパ・クリエイト	23,300	1,646.00	38,351,800
エコートレーディング	1,600	1,328.00	2,124,800
伯東	8,500	5,190.00	44,115,000
コンドーテック	11,300	1,151.00	13,006,300
中山福	4,700	351.00	1,649,700
ライトオン	6,200	429.00	2,659,800
ナガイレーベン	18,700	2,169.00	40,560,300
三菱食品	13,700	4,435.00	60,759,500
良品計画	161,500	2,117.50	341,976,250
パリミキホールディングス	10,300	387.00	3,986,100
松田産業	11,200	2,422.00	27,126,400
第一興商	57,200	2,200.50	125,868,600
メディopalホールディングス	153,300	2,483.50	380,720,550
アドヴァングループ	14,100	1,033.00	14,565,300
S P K	6,500	1,797.00	11,680,500
萩原電気ホールディングス	6,300	4,365.00	27,499,500
アルビス	4,900	2,574.00	12,612,600
アズワン	23,200	4,973.00	115,373,600
スズデン	5,200	2,193.00	11,403,600
尾家産業	2,000	1,757.00	3,514,000
シモジマ	10,200	1,185.00	12,087,000
ドウシシャ	13,700	2,080.00	28,496,000
小津産業	1,900	1,568.00	2,979,200
コナカ	8,900	392.00	3,488,800
高速	8,800	1,997.00	17,573,600
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,604.00	1,604,000

G-7ホールディングス	16,100	1,157.00	18,627,700
たけびし	5,700	1,829.00	10,425,300
イオン北海道	43,700	888.00	38,805,600
コジマ	24,500	650.00	15,925,000
ヒマラヤ	2,600	914.00	2,376,400
コーナン商事	18,200	3,700.00	67,340,000
ネットワンシステムズ	56,600	2,055.50	116,341,300
エコス	5,500	2,180.00	11,990,000
ワタミ	15,700	1,111.00	17,442,700
マルシェ	2,900	272.00	788,800
リックス	2,600	3,405.00	8,853,000
システムソフト	49,000	67.00	3,283,000
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	298,800	3,221.00	962,434,800
丸文	13,200	1,294.00	17,080,800
西松屋チェーン	29,100	1,855.00	53,980,500
ゼンショーホールディングス	72,900	8,889.00	648,008,100
ハビネット	12,600	2,357.00	29,698,200
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,111.00	12,221,000
ハークスレイ	2,900	724.00	2,099,600
橋本総業ホールディングス	5,800	1,173.00	6,803,400
日本ライフライン	43,300	1,107.00	47,933,100
サイゼリヤ	21,900	5,570.00	121,983,000
タカショー	13,000	589.00	7,657,000
VTホールディングス	56,200	511.00	28,718,200
アルゴグラフィックス	12,900	3,395.00	43,795,500
魚力	5,200	2,201.00	11,445,200
IDOM	39,200	870.00	34,104,000
日本エム・ディ・エム	11,100	675.00	7,492,500
ポブラ	2,200	193.00	424,600
フジ・コーポレーション	7,300	1,744.00	12,731,200
ユナイテッドアローズ	17,300	1,775.00	30,707,500
進和	9,000	2,376.00	21,384,000
エスケイジャパン	2,100	778.00	1,633,800
ダイトロン	5,800	2,871.00	16,651,800
ハイデイ日高	21,900	2,750.00	60,225,000
シークス	21,100	1,452.00	30,637,200
YU-WA CREATION HOLDINGS	4,500	155.00	697,500
コロワイド	63,700	2,375.00	151,287,500
田中商事	2,400	683.00	1,639,200
オーハシテクニカ	7,900	1,774.00	14,014,600
壺番屋	11,700	5,380.00	62,946,000
白銅	4,300	2,233.00	9,601,900
トップカルチャー	2,400	173.00	415,200
PLANT	1,900	1,326.00	2,519,400
スギホールディングス	29,800	6,193.00	184,551,400
ダイコー通産	800	1,123.00	898,400
薬王堂ホールディングス	7,300	2,713.00	19,804,900
島津製作所	185,800	3,757.00	698,050,600

JMS	13,000	508.00	6,604,000
クボテック	2,200	263.00	578,600
長野計器	10,200	2,114.00	21,562,800
ブイ・テクノロジー	7,400	2,167.00	16,035,800
スター精密	26,300	1,779.00	46,787,700
東京計器	10,700	1,630.00	17,441,000
愛知時計電機	6,000	2,296.00	13,776,000
インターアクション	6,600	1,017.00	6,712,200
オーバル	6,900	471.00	3,249,900
東京精密	28,600	8,280.00	236,808,000
マニー	56,000	2,041.00	114,296,000
ニコン	202,200	1,398.00	282,675,600
トプコン	68,000	1,500.50	102,034,000
オリンパス	861,000	2,078.00	1,789,158,000
理研計器	9,900	5,970.00	59,103,000
SCREENホールディングス	47,800	9,341.00	446,499,800
キャノン電子	15,500	1,930.00	29,915,000
タムロン	8,600	4,125.00	35,475,000
HOYA	277,900	15,410.00	4,282,439,000
シード	3,900	719.00	2,804,100
ノーリツ鋼機	13,300	3,120.00	41,496,000
A&Dホロンホールディングス	20,400	1,700.00	34,680,000
朝日インテック	156,300	2,642.00	412,944,600
キャノン	697,700	3,729.00	2,601,723,300
リコー	350,700	1,216.50	426,626,550
シチズン時計	128,700	894.00	115,057,800
リズム	1,800	2,683.00	4,829,400
大研医器	6,600	528.00	3,484,800
メニコン	48,100	1,845.00	88,744,500
シンシア	900	549.00	494,100
KYORITSU	11,500	173.00	1,989,500
中本パックス	2,600	1,625.00	4,225,000
スノーピーク	19,900	1,004.00	19,979,600
パラマウントベッドホールディングス	29,100	2,636.00	76,707,600
トランザクション	9,200	2,124.00	19,540,800
粧美堂	2,100	491.00	1,031,100
ニホンフラッシュ	13,100	876.00	11,475,600
前田工織	11,800	2,946.00	34,762,800
永大産業	9,000	216.00	1,944,000
アートネイチャー	12,700	782.00	9,931,400
バンダイナムコホールディングス	383,200	3,026.00	1,159,563,200
アイフイスジャパン	2,200	615.00	1,353,000
SHOEI	31,700	2,088.00	66,189,600
フランスベッドホールディングス	18,100	1,260.00	22,806,000
マーベラス	22,700	690.00	15,663,000
パイロットコーポレーション	19,700	4,520.00	89,044,000
萩原工業	9,300	1,575.00	14,647,500
エイベックス	23,900	1,291.00	30,854,900
フジシールインターナショナル	28,400	1,656.00	47,030,400
タカラトミー	63,700	2,086.00	132,878,200

広済堂ホールディングス	6,300	3,245.00	20,443,500
エステールホールディングス	2,000	624.00	1,248,000
レック	18,000	929.00	16,722,000
タカノ	2,900	806.00	2,337,400
三光合成	17,700	537.00	9,504,900
プロネクサス	14,500	1,158.00	16,791,000
ホクシン	6,000	119.00	714,000
ウッドワン	2,800	997.00	2,791,600
きもと	13,000	189.00	2,457,000
TOPPANホールディングス	171,900	3,349.00	575,693,100
大日本印刷	152,900	4,023.00	615,116,700
共同印刷	3,900	3,545.00	13,825,500
NISSHA	24,000	1,502.00	36,048,000
光村印刷	600	1,259.00	755,400
藤森工業	11,100	3,875.00	43,012,500
ヴィア・ホールディングス	12,300	187.00	2,300,100
TAKARA & COMPANY	8,900	2,345.00	20,870,500
前澤化成工業	9,000	1,551.00	13,959,000
未来工業	5,000	3,335.00	16,675,000
アシックス	119,100	4,917.00	585,614,700
ツツミ	2,400	2,153.00	5,167,200
ウェーブロックホールディングス	2,900	626.00	1,815,400
JSP	9,900	1,772.00	17,542,800
ニチハ	17,600	2,780.00	48,928,000
ローランド	10,300	4,660.00	47,998,000
エフピコ	26,600	2,855.50	75,956,300
小松ウオール工業	5,700	2,873.00	16,376,100
ヤマハ	88,200	3,499.00	308,611,800
河合楽器製作所	4,300	3,400.00	14,620,000
クリナップ	13,700	675.00	9,247,500
ピジョン	89,100	1,623.50	144,653,850
天馬	10,200	2,451.00	25,000,200
キングジム	12,400	863.00	10,701,200
象印マホービン	38,000	1,536.00	58,368,000
リンテック	28,000	2,474.00	69,272,000
信越ポリマー	30,200	1,368.00	41,313,600
東リ	19,200	344.00	6,604,800
イトーキ	28,700	1,358.00	38,974,600
任天堂	883,100	7,014.00	6,194,063,400
三菱鉛筆	19,800	1,830.00	36,234,000
松風	6,300	2,520.00	15,876,000
タカラスタナダード	29,400	1,772.00	52,096,800
コクヨ	57,200	2,410.00	137,852,000
ナカバヤシ	15,100	517.00	7,806,700
ニフコ	42,000	3,849.00	161,658,000
立川ブラインド工業	6,500	1,440.00	9,360,000
グローブライド	12,600	1,937.00	24,406,200
オカムラ	42,200	2,150.00	90,730,000
バルカー	11,700	3,780.00	44,226,000
MUTOHホールディングス	1,000	2,006.00	2,006,000

伊藤忠商事	994,900	5,900.00	5,869,910,000
丸紅	1,233,900	2,357.00	2,908,302,300
スクロール	22,000	904.00	19,888,000
高島	5,600	977.00	5,471,200
ヨンドシーホールディングス	14,000	1,919.00	26,866,000
三陽商会	4,600	2,595.00	11,937,000
長瀬産業	67,800	2,295.50	155,634,900
ナイガイ	2,600	270.00	702,000
蝶理	9,200	2,839.00	26,118,800
豊田通商	129,600	8,591.00	1,113,393,600
オンワードホールディングス	82,600	484.00	39,978,400
三共生興	20,600	780.00	16,068,000
兼松	61,900	2,013.00	124,604,700
美津濃	13,900	4,055.00	56,364,500
ツカモトコーポレーション	1,100	1,164.00	1,280,400
ルックホールディングス	3,400	2,157.00	7,333,800
三井物産	1,115,100	5,625.00	6,272,437,500
日本紙パルプ商事	7,100	4,650.00	33,015,000
東京エレクトロン	296,000	22,575.00	6,682,200,000
カメイ	15,700	1,553.00	24,382,100
東都水産	400	7,080.00	2,832,000
OUGホールディングス	1,200	2,384.00	2,860,800
スターゼン	10,200	2,485.00	25,347,000
セイコーグループ	19,500	2,296.00	44,772,000
山善	44,900	1,209.00	54,284,100
椿本興業	3,000	5,420.00	16,260,000
住友商事	895,700	3,223.00	2,886,841,100
BIPROGY	45,900	4,009.00	184,013,100
内田洋行	6,000	6,840.00	41,040,000
三菱商事	977,500	7,148.00	6,987,170,000
第一実業	13,900	1,928.00	26,799,200
キャノンマーケティングジャパン	34,300	3,753.00	128,727,900
西華産業	5,800	2,470.00	14,326,000
佐藤商事	10,400	1,492.00	15,516,800
菱洋エレクトロ	14,000	3,505.00	49,070,000
東京産業	13,500	823.00	11,110,500
ユアサ商事	11,500	4,180.00	48,070,000
神鋼商事	3,700	5,610.00	20,757,000
トルク	4,500	263.00	1,183,500
阪和興業	26,600	4,320.00	114,912,000
正栄食品工業	9,900	4,385.00	43,411,500
カナデン	11,100	1,463.00	16,239,300
RYODEN	11,900	2,472.00	29,416,800
ニプロ	116,500	1,094.00	127,451,000
岩谷産業	33,700	7,021.00	236,607,700
ナイス	2,600	1,458.00	3,790,800
ニチモウ	1,200	3,930.00	4,716,000
極東貿易	8,800	1,782.00	15,681,600
アステナホールディングス	27,800	515.00	14,317,000
三愛オブリ	35,500	1,560.00	55,380,000

稲畑産業	29,300	3,200.00	93,760,000
G S Iクレオス	7,900	2,002.00	15,815,800
明和産業	17,600	651.00	11,457,600
クワザワホールディングス	3,000	519.00	1,557,000
キムラタン	50,500	19.00	959,500
ゴールドウイン	24,800	10,970.00	272,056,000
ユニ・チャーム	292,300	4,831.00	1,412,101,300
デサント	24,100	4,400.00	106,040,000
キング	2,900	696.00	2,018,400
ワキタ	24,500	1,483.00	36,333,500
ヤマトインターナショナル	6,100	294.00	1,793,400
東邦ホールディングス	40,900	3,510.00	143,559,000
サンゲツ	34,100	2,725.00	92,922,500
ミツウロコグループホールディングス	18,900	1,298.00	24,532,200
シナネンホールディングス	4,100	4,020.00	16,482,000
伊藤忠エネクス	36,700	1,546.00	56,738,200
サンリオ	42,000	7,042.00	295,764,000
サンワテクノス	7,600	2,150.00	16,340,000
リョーサン	10,500	4,630.00	48,615,000
新光商事	19,900	1,129.00	22,467,100
トーヨー	5,700	3,155.00	17,983,500
三信電気	5,900	2,226.00	13,133,400
東陽テクニカ	15,100	1,339.00	20,218,900
モスフードサービス	21,800	3,265.00	71,177,000
加賀電子	13,500	6,040.00	81,540,000
三益半導体工業	11,100	2,634.00	29,237,400
都築電気	7,400	2,114.00	15,643,600
ソーダニッカ	10,900	975.00	10,627,500
立花エレテック	9,900	2,696.00	26,690,400
木曽路	22,400	2,590.00	58,016,000
S R Sホールディングス	24,400	1,050.00	25,620,000
千趣会	27,200	411.00	11,179,200
タカキュー	5,700	78.00	444,600
リテールパートナーズ	21,900	1,765.00	38,653,500
ケーヨー	22,200	1,296.00	28,771,200
上新電機	14,600	2,247.00	32,806,200
日本瓦斯	78,400	2,368.00	185,651,200
ロイヤルホールディングス	26,100	2,561.00	66,842,100
東天紅	600	800.00	480,000
いなげや	13,900	1,601.00	22,253,900
チヨダ	14,200	810.00	11,502,000
ライフコーポレーション	15,500	3,430.00	53,165,000
リンガーハット	19,100	2,330.00	44,503,000
MrMaxHD	18,700	616.00	11,519,200
テンアライド	10,700	301.00	3,220,700
AOKIホールディングス	31,700	1,062.00	33,665,400
オークワ	21,300	834.00	17,764,200
コメリ	22,700	3,110.00	70,597,000
青山商事	31,700	1,397.00	44,284,900
しまむら	17,300	14,930.00	258,289,000

はせがわ	3,900	352.00	1,372,800
高島屋	102,300	2,055.00	210,226,500
松屋	25,100	892.00	22,389,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	65,400	1,645.00	107,583,000
近鉄百貨店	6,300	2,635.00	16,600,500
丸井グループ	98,300	2,424.00	238,279,200
クレディセゾン	87,300	2,475.00	216,067,500
アクシアル リテイリング	10,100	3,925.00	39,642,500
井筒屋	3,900	351.00	1,368,900
イオン	501,700	3,132.00	1,571,324,400
イズミ	26,300	3,703.00	97,388,900
フォーバル	5,800	1,181.00	6,849,800
平和堂	24,700	2,300.00	56,810,000
フジ	22,700	1,900.00	43,130,000
ヤオコー	16,700	7,770.00	129,759,000
ゼビオホールディングス	20,000	924.00	18,480,000
ケーズホールディングス	104,600	1,292.00	135,143,200
PAL TAC	19,900	4,839.00	96,296,100
三谷産業	26,000	334.00	8,684,000
Olympicグループ	3,500	507.00	1,774,500
日産東京販売ホールディングス	12,300	437.00	5,375,100
あおぞら銀行	99,000	3,060.00	302,940,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,627,900	1,253.00	10,810,758,700
りそなホールディングス	1,606,500	781.40	1,255,319,100
三井住友トラスト・ホールディングス	247,500	5,478.00	1,355,805,000
三井住友フィナンシャルグループ	979,500	7,068.00	6,923,106,000
千葉銀行	383,900	1,087.50	417,491,250
群馬銀行	267,300	692.40	185,078,520
武蔵野銀行	19,200	2,696.00	51,763,200
千葉興業銀行	22,700	889.00	20,180,300
筑波銀行	60,300	266.00	16,039,800
七十七銀行	40,100	3,620.00	145,162,000
秋田銀行	9,200	2,019.00	18,574,800
山形銀行	15,300	1,141.00	17,457,300
岩手銀行	8,700	2,582.00	22,463,400
東邦銀行	109,100	290.00	31,639,000
東北銀行	3,700	1,182.00	4,373,400
ふくおかフィナンシャルグループ	120,000	3,720.00	446,400,000
スルガ銀行	121,400	678.00	82,309,200
八十二銀行	295,600	800.00	236,480,000
山梨中央銀行	15,400	1,885.00	29,029,000
大垣共立銀行	26,300	1,882.00	49,496,600
福井銀行	12,400	1,564.00	19,393,600
清水銀行	5,500	1,562.00	8,591,000
富山銀行	1,400	1,726.00	2,416,400
滋賀銀行	23,000	3,910.00	89,930,000
南都銀行	20,800	2,541.00	52,852,800
百五銀行	129,500	539.00	69,800,500
紀陽銀行	49,300	1,527.00	75,281,100
ほくほくフィナンシャルグループ	85,300	1,659.50	141,555,350

山陰合同銀行	86,200	966.00	83,269,200
鳥取銀行	2,700	1,330.00	3,591,000
百十四銀行	13,500	2,699.00	36,436,500
四国銀行	20,200	1,017.00	20,543,400
阿波銀行	19,300	2,429.00	46,879,700
大分銀行	8,300	2,691.00	22,335,300
宮崎銀行	8,300	2,798.00	23,223,400
佐賀銀行	8,100	1,967.00	15,932,700
琉球銀行	29,300	1,153.00	33,782,900
セブン銀行	431,800	295.40	127,553,720
みずほフィナンシャルグループ	1,859,600	2,479.00	4,609,948,400
高知銀行	2,600	981.00	2,550,600
山口フィナンシャルグループ	135,000	1,313.00	177,255,000
芙蓉総合リース	12,700	11,960.00	151,892,000
みずほリース	23,100	5,030.00	116,193,000
東京センチュリー	25,800	5,727.00	147,756,600
SBIホールディングス	201,600	3,238.00	652,780,800
日本証券金融	50,600	1,546.00	78,227,600
アイフル	202,800	379.00	76,861,200
日本アジア投資	5,600	230.00	1,288,000
名古屋銀行	8,900	5,840.00	51,976,000
北洋銀行	208,700	378.00	78,888,600
大光銀行	2,500	1,350.00	3,375,000
愛媛銀行	18,600	1,066.00	19,827,600
トマト銀行	2,800	1,144.00	3,203,200
京葉銀行	57,800	689.00	39,824,200
栃木銀行	68,900	337.00	23,219,300
北日本銀行	4,500	2,183.00	9,823,500
東和銀行	25,200	621.00	15,649,200
福島銀行	8,100	259.00	2,097,900
大東銀行	3,300	788.00	2,600,400
リコーリース	13,100	4,530.00	59,343,000
イオンフィナンシャルサービス	79,000	1,254.00	99,066,000
アコム	246,000	342.30	84,205,800
ジャックス	14,600	5,210.00	76,066,000
オリエントコーポレーション	44,900	1,050.00	47,145,000
オリックス	839,700	2,670.00	2,241,999,000
三菱HCキャピタル	613,800	948.50	582,189,300
ジャフコグループ	41,000	1,623.00	66,543,000
九州リースサービス	3,000	920.00	2,760,000
トモニホールディングス	111,400	485.00	54,029,000
大和証券グループ本社	1,067,200	958.10	1,022,484,320
野村ホールディングス	2,316,900	604.00	1,399,407,600
岡三証券グループ	121,000	707.00	85,547,000
丸三証券	45,800	864.00	39,571,200
東洋証券	36,600	302.00	11,053,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	163,500	540.00	88,290,000
光世証券	1,800	540.00	972,000
水戸証券	40,700	440.00	17,908,000

いちよし証券	25,900	710.00	18,389,000
松井証券	67,800	751.00	50,917,800
SOMPOホールディングス	218,200	6,506.00	1,419,609,200
日本取引所グループ	359,400	3,139.00	1,128,156,600
マネックスグループ	134,900	646.00	87,145,400
極東証券	18,900	1,077.00	20,355,300
岩井コスモホールディングス	15,700	1,752.00	27,506,400
アイザワ証券グループ	19,900	1,151.00	22,904,900
フィデアホールディングス	14,200	1,510.00	21,442,000
池田泉州ホールディングス	190,800	361.00	68,878,800
アニコムホールディングス	46,700	575.00	26,852,500
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	308,500	5,666.00	1,747,961,000
マネーパートナーズグループ	8,000	285.00	2,280,000
スパークス・グループ	15,400	1,448.00	22,299,200
小林洋行	2,900	233.00	675,700
第一生命ホールディングス	673,200	3,077.00	2,071,436,400
東京海上ホールディングス	1,361,800	3,488.00	4,749,958,400
アドバンテッジリスクマネジメント	4,100	457.00	1,873,700
イー・ギャランティ	22,400	1,808.00	40,499,200
アサックス	3,400	664.00	2,257,600
NECキャピタルソリューション	6,800	3,265.00	22,202,000
T&Dホールディングス	400,500	2,618.00	1,048,509,000
アドバンスクリエイト	8,000	947.00	7,576,000
三井不動産	637,100	3,323.00	2,117,083,300
三菱地所	900,600	1,990.00	1,792,194,000
平和不動産	22,300	3,895.00	86,858,500
東京建物	120,400	2,050.00	246,820,000
京阪神ビルディング	25,800	1,315.00	33,927,000
住友不動産	199,200	4,135.00	823,692,000
太平洋興発	3,000	776.00	2,328,000
テーオーシー	24,600	608.00	14,956,800
東京楽天地	2,200	4,150.00	9,130,000
レオパレス21	137,800	395.00	54,431,000
スターツコーポレーション	19,700	2,772.00	54,608,400
フジ住宅	17,300	694.00	12,006,200
空港施設	19,400	560.00	10,864,000
明和地所	6,900	1,155.00	7,969,500
ゴールドクレスト	11,200	2,040.00	22,848,000
リログループ	72,100	1,538.00	110,889,800
エスリード	6,400	3,065.00	19,616,000
日神グループホールディングス	22,200	493.00	10,944,600
日本エスコン	25,800	893.00	23,039,400
MIRARTHホールディングス	63,300	442.00	27,978,600
AVANTIA	4,300	833.00	3,581,900
イオンモール	71,400	1,741.00	124,307,400
毎日コムネット	2,900	705.00	2,044,500
ファースト住建	3,100	1,086.00	3,366,600
ランド	753,800	8.00	6,030,400
カチタス	37,100	2,137.00	79,282,700

東祥	10,100	798.00	8,059,800
トーセイ	23,000	1,907.00	43,861,000
穴吹興産	1,600	1,977.00	3,163,200
サンフロンティア不動産	20,400	1,547.00	31,558,800
FJネクストホールディングス	14,500	1,184.00	17,168,000
インテリックス	2,000	505.00	1,010,000
ランドビジネス	2,900	330.00	957,000
サンネクスタグループ	2,300	942.00	2,166,600
グランディハウス	9,000	620.00	5,580,000
東武鉄道	153,600	3,802.00	583,987,200
相鉄ホールディングス	50,100	2,664.00	133,466,400
東急	392,200	1,763.00	691,448,600
京浜急行電鉄	173,000	1,339.00	231,647,000
小田急電鉄	231,300	2,248.50	520,078,050
京王電鉄	67,200	4,383.00	294,537,600
京成電鉄	90,200	6,178.00	557,255,600
富士急行	17,200	4,270.00	73,444,000
東日本旅客鉄道	257,000	7,849.00	2,017,193,000
西日本旅客鉄道	165,900	5,876.00	974,828,400
東海旅客鉄道	538,800	3,461.00	1,864,786,800
西武ホールディングス	169,200	1,509.50	255,407,400
鴻池運輸	23,800	1,868.00	44,458,400
西日本鉄道	37,400	2,386.00	89,236,400
ハマキョウレックス	11,900	3,870.00	46,053,000
サカイ引越センター	15,500	2,523.00	39,106,500
近鉄グループホールディングス	139,600	4,172.00	582,411,200
阪急阪神ホールディングス	186,200	4,623.00	860,802,600
南海電気鉄道	62,200	2,917.50	181,468,500
京阪ホールディングス	77,000	3,794.00	292,138,000
神戸電鉄	3,800	2,849.00	10,826,200
名古屋鉄道	144,100	2,070.00	298,287,000
山陽電気鉄道	10,500	2,119.00	22,249,500
アルプス物流	11,100	1,599.00	17,748,900
トランコム	4,100	7,430.00	30,463,000
ヤマトホールディングス	178,900	2,572.50	460,220,250
山九	35,500	4,826.00	171,323,000
日新	10,600	2,500.00	26,500,000
丸運	4,400	247.00	1,086,800
丸全昭和運輸	8,600	3,815.00	32,809,000
センコーグループホールディングス	73,900	1,020.00	75,378,000
トナミホールディングス	3,100	4,410.00	13,671,000
ニッコンホールディングス	44,700	3,150.00	140,805,000
日本石油輸送	700	2,889.00	2,022,300
福山通運	15,900	3,420.00	54,378,000
セイノーホールディングス	78,500	2,031.50	159,472,750
エスライングループ本社	2,200	878.00	1,931,600
神奈川中央交通	3,900	3,085.00	12,031,500
AZ-COM丸和ホールディングス	33,800	2,010.00	67,938,000
C&Fロジホールディングス	13,500	1,401.00	18,913,500
日本郵船	400,300	3,677.00	1,471,903,100

商船三井	303,100	3,809.00	1,154,507,900
川崎汽船	118,000	4,703.00	554,954,000
NSユニテッド海運	7,500	4,465.00	33,487,500
明海グループ	8,500	642.00	5,457,000
飯野海運	51,300	1,132.00	58,071,600
共栄タンカー	1,400	818.00	1,145,200
九州旅客鉄道	98,700	3,048.00	300,837,600
SGホールディングス	234,500	2,051.50	481,076,750
NIPPON EXPRESSホールディングス	47,400	7,603.00	360,382,200
ID&E ホールディングス	8,600	3,330.00	28,638,000
日本航空	343,000	2,832.00	971,376,000
ANAホールディングス	380,000	3,055.00	1,160,900,000
ビーウィズ	3,600	2,080.00	7,488,000
パスコ	1,500	1,575.00	2,362,500
TREホールディングス	27,500	1,175.00	32,312,500
人・夢・技術グループ	5,400	1,771.00	9,563,400
西本Wismettacホールディングス	3,700	5,940.00	21,978,000
シルバーライフ	2,800	1,043.00	2,920,400
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,020.00	1,212,000
Genky Drug Stores	6,400	5,170.00	33,088,000
コア商事ホールディングス	8,300	771.00	6,399,300
KPPグループホールディングス	38,300	628.00	24,052,400
ナルミヤ・インターナショナル	1,400	1,020.00	1,428,000
ブックオフグループホールディングス	7,500	1,040.00	7,800,000
ギフトホールディングス	6,200	2,143.00	13,286,600
三菱倉庫	34,300	4,376.00	150,096,800
三井倉庫ホールディングス	13,100	4,620.00	60,522,000
住友倉庫	37,600	2,383.00	89,600,800
澁澤倉庫	6,300	2,742.00	17,274,600
ヤマタネ	6,500	2,261.00	14,696,500
東陽倉庫	2,100	1,484.00	3,116,400
乾汽船	16,300	1,145.00	18,663,500
日本トランスシティ	28,100	643.00	18,068,300
ケイヒン	1,400	1,763.00	2,468,200
中央倉庫	7,500	1,065.00	7,987,500
川西倉庫	1,500	1,071.00	1,606,500
安田倉庫	9,600	1,080.00	10,368,000
ファイズホールディングス	1,100	996.00	1,095,600
NISSOホールディングス	12,500	774.00	9,675,000
大栄環境	26,200	2,289.00	59,971,800
日本管財ホールディングス	15,100	2,499.00	37,734,900
東洋埠頭	2,200	1,369.00	3,011,800
上組	67,000	3,226.00	216,142,000
サンリツ	1,900	725.00	1,377,500
キムラユニティー	3,700	1,343.00	4,969,100
キューソー流通システム	5,600	921.00	5,157,600
東海運	4,700	283.00	1,330,100
エアアティー	8,700	1,624.00	14,128,800

内外トランスライン	5,600	2,443.00	13,680,800
ショーエイコーポレーション	2,600	582.00	1,513,200
日本コンセプト	5,100	1,759.00	8,970,900
TBSホールディングス	71,800	2,481.50	178,171,700
日本テレビホールディングス	124,200	1,455.00	180,711,000
朝日放送グループホールディングス	13,100	630.00	8,253,000
テレビ朝日ホールディングス	34,100	1,601.00	54,594,100
スカパーJ SATホールディングス	109,000	679.00	74,011,000
テレビ東京ホールディングス	10,100	2,688.00	27,148,800
日本BS放送	2,800	881.00	2,466,800
ビジョン	21,200	1,270.00	26,924,000
スマートバリュー	1,900	365.00	693,500
USEN-NEXT HOLDINGS	15,700	3,505.00	55,028,500
ワイヤレスゲート	3,500	179.00	626,500
日本通信	138,000	215.00	29,670,000
クロップス	1,000	991.00	991,000
日本電信電話	41,729,400	174.10	7,265,088,540
KDDI	1,084,100	4,640.00	5,030,224,000
ソフトバンク	2,256,900	1,763.00	3,978,914,700
光通信	14,100	21,435.00	302,233,500
エムティーアイ	9,700	576.00	5,587,200
GMOインターネットグループ	51,800	2,307.00	119,502,600
ファイバーゲート	7,600	1,115.00	8,474,000
アイドママーケティングコミュニケーション	2,200	230.00	506,000
KADOKAWA	74,200	2,697.50	200,154,500
学研ホールディングス	23,300	925.00	21,552,500
ゼンリン	23,900	883.00	21,103,700
昭文社ホールディングス	3,400	360.00	1,224,000
インプレスホールディングス	7,900	179.00	1,414,100
東京電力ホールディングス	1,260,900	662.30	835,094,070
中部電力	515,500	1,825.50	941,045,250
関西電力	540,100	1,932.50	1,043,743,250
中国電力	243,100	996.40	242,224,840
北陸電力	143,000	772.90	110,524,700
東北電力	368,200	945.50	348,133,100
四国電力	130,300	1,051.00	136,945,300
九州電力	322,400	1,010.50	325,785,200
北海道電力	135,100	637.40	86,112,740
沖縄電力	35,700	1,071.00	38,234,700
電源開発	114,900	2,311.00	265,533,900
エフオン	9,000	463.00	4,167,000
イーレックス	24,900	633.00	15,761,700
レノバ	37,300	1,059.00	39,500,700
東京瓦斯	295,700	3,314.00	979,949,800
大阪瓦斯	283,400	2,866.00	812,224,400
東邦瓦斯	60,600	2,762.00	167,377,200
北海道瓦斯	8,300	2,350.00	19,505,000
広島ガス	29,600	377.00	11,159,200

西部ガスホールディングス	14,500	1,898.00	27,521,000
静岡ガス	27,900	998.00	27,844,200
メタウォーター	16,700	2,000.00	33,400,000
M&A総研ホールディングス	6,900	3,670.00	25,323,000
アイネット	8,500	1,820.00	15,470,000
松竹	7,300	9,844.00	71,861,200
東宝	78,000	5,082.00	396,396,000
エイチ・アイ・エス	41,800	1,754.00	73,317,200
東映	4,700	18,140.00	85,258,000
ラックランド	6,500	2,700.00	17,550,000
NTTデータグループ	366,800	1,821.50	668,126,200
共立メンテナンス	22,500	6,025.00	135,562,500
イチネンホールディングス	15,200	1,492.00	22,678,400
建設技術研究所	7,400	4,785.00	35,409,000
スペース	9,300	901.00	8,379,300
アインホールディングス	20,400	4,183.00	85,333,200
燦ホールディングス	13,500	1,074.00	14,499,000
ピー・シー・エー	8,100	1,121.00	9,080,100
スバル興業	600	13,860.00	8,316,000
東京テアトル	3,000	1,068.00	3,204,000
タナベコンサルティンググループ	4,400	997.00	4,386,800
ビジネスブレイン太田昭和	5,500	2,091.00	11,500,500
ナガワ	4,500	6,400.00	28,800,000
東京都競馬	12,000	4,100.00	49,200,000
常磐興産	3,000	1,225.00	3,675,000
カナモト	22,200	2,516.00	55,855,200
DTS	29,900	3,240.00	96,876,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	64,100	5,386.00	345,242,600
シーイーシー	17,800	1,641.00	29,209,800
カプコン	125,500	5,038.00	632,269,000
ニシオホールディングス	13,400	3,400.00	45,560,000
アイ・エス・ビー	7,200	1,430.00	10,296,000
アゴーラ ホスピタリティール グループ	51,800	23.00	1,191,400
日本空港ビルデング	48,700	6,644.00	323,562,800
トランス・コスモス	17,900	3,125.00	55,937,500
乃村工藝社	62,700	859.00	53,859,300
ジャステック	8,600	1,520.00	13,072,000
SCSK	98,200	2,703.00	265,434,600
藤田観光	5,700	3,930.00	22,401,000
KNT-CTホールディングス	8,600	1,252.00	10,767,200
トーカイ	12,800	1,877.00	24,025,600
白洋舎	1,200	2,457.00	2,948,400
セコム	146,500	10,795.00	1,581,467,500
NSW	6,200	2,824.00	17,508,800
セントラル警備保障	7,800	2,549.00	19,882,200
アイネス	10,900	1,565.00	17,058,500
丹青社	27,800	868.00	24,130,400
メイテックグループホールディングス	51,700	2,810.00	145,277,000

TKC	22,200	3,540.00	78,588,000
富士ソフト	28,300	5,390.00	152,537,000
応用地質	13,400	2,132.00	28,568,800
船井総研ホールディングス	29,900	2,482.00	74,211,800
NSD	50,100	2,598.00	130,159,800
進学会ホールディングス	2,200	279.00	613,800
丸紅建材リース	600	2,496.00	1,497,600
オオバ	5,000	930.00	4,650,000
コナミグループ	52,600	7,982.00	419,853,200
いであ	2,200	1,631.00	3,588,200
学究社	5,700	1,912.00	10,898,400
ベネッセホールディングス	48,300	2,348.00	113,408,400
イオンディライト	15,900	3,350.00	53,265,000
ナック	6,100	977.00	5,959,700
福井コンピュータホールディングス	8,600	2,582.00	22,205,200
ダイセキ	29,400	4,085.00	120,099,000
ステップ	5,300	1,858.00	9,847,400
泉州電業	7,400	3,215.00	23,791,000
元気寿司	8,300	3,455.00	28,676,500
トラスコ中山	31,100	2,318.00	72,089,800
ヤマダホールディングス	455,200	426.20	194,006,240
オートバックスセブン	51,500	1,512.00	77,868,000
モリト	10,600	1,327.00	14,066,200
アークランズ	44,000	1,581.00	69,564,000
ニトリホールディングス	53,900	14,875.00	801,762,500
グルメ杵屋	11,900	1,081.00	12,863,900
愛眼	6,100	172.00	1,049,200
ケーユーホールディングス	7,000	1,130.00	7,910,000
吉野家ホールディングス	54,500	3,387.00	184,591,500
加藤産業	18,300	4,560.00	83,448,000
北恵	2,100	998.00	2,095,800
イノテック	9,300	1,647.00	15,317,100
イエローハット	23,500	1,723.00	40,490,500
松屋フーズホールディングス	7,000	4,815.00	33,705,000
JBC Cホールディングス	9,200	3,120.00	28,704,000
JKホールディングス	11,400	954.00	10,875,600
サガミホールディングス	22,200	1,337.00	29,681,400
日伝	10,000	2,549.00	25,490,000
関西フードマーケット	10,100	1,393.00	14,069,300
ミロク情報サービス	12,800	1,515.00	19,392,000
北沢産業	5,000	278.00	1,390,000
杉本商事	7,200	2,179.00	15,688,800
因幡電機産業	38,300	3,210.00	122,943,000
王将フードサービス	11,000	8,000.00	88,000,000
ミニストップ	10,800	1,520.00	16,416,000
アークス	27,100	2,764.00	74,904,400
パローホールディングス	28,300	2,319.00	65,627,700
東テク	5,000	4,940.00	24,700,000
ミスミグループ本社	223,400	2,409.00	538,170,600
アルテック	4,400	235.00	1,034,000

ベルク	7,400	6,590.00	48,766,000
大 庄	6,200	1,264.00	7,836,800
タキヒヨー	2,000	991.00	1,982,000
ファーストリテイリング	66,600	35,490.00	2,363,634,000
ソフトバンクグループ	692,000	5,762.00	3,987,304,000
蔵王産業	1,500	2,429.00	3,643,500
スズケン	56,300	4,855.00	273,336,500
サンドラッグ	50,000	4,057.00	202,850,000
サックスパー ホールディングス	12,500	813.00	10,162,500
ジェコス	8,800	954.00	8,395,200
ヤマザワ	1,800	1,255.00	2,259,000
やまや	1,700	2,919.00	4,962,300
グローセル	15,200	432.00	6,566,400
ベルーナ	35,600	613.00	21,822,800
合計	212,353,800		464,832,873,580

(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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	903,853,082
コール・ローン	751,121,615
国債証券	255,838,379,012
派生商品評価勘定	14,037,576
未収入金	6,007,107
未収利息	1,010,492,551
前払費用	1,279,403,749
流動資産合計	259,803,294,692
資産合計	259,803,294,692
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,400,716,007
未払金	299,296,026
未払解約金	11,484,000
流動負債合計	2,711,496,033
負債合計	2,711,496,033
純資産の部	
元本等	
元本	225,046,892,131
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	32,044,906,528
元本等合計	257,091,798,659
純資産合計	257,091,798,659
負債純資産合計	259,803,294,692

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11月12日 至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	182,027,030,485円
同期中追加設定元本額	686,932,777,209円
同期中一部解約元本額	643,912,915,563円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	11,832,890,267円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,477,037,139円
たわらノーロード バランス (標準型)	4,175,857,564円
たわらノーロード バランス (積極型)	2,093,929,794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)	36,317,281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)	1,403,348,320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)	1,310,518,953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)	75,400,253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)	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	4,915,860円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	15,763,847円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	155,539,287円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,208,828円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	91,804円
投資のソムリエ	94,336,521,913円
投資のソムリエ<DC年金>	8,563,627,565円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,442,263,496円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	32,967,497,884円
ワールドアセットバランス (基本コース)	1,843,203,229円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	3,398,486,689円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	450,572,426円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	225,687,044円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	76,421,331円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,642,595,676円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,228,334,852円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,419,121,804円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	678,490,497円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	246,840,221円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	149,628,359円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	35,884,245円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	22,917,239円
外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）	21,358,530,675円
先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	7,305,629,636円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	2,794,621,890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）	43,701,777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）	430,471,766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）	34,398,469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）	284,715,761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）	624,442,297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）	857,292,800円
計	225,046,892,131円
2. 受益権の総数	225,046,892,131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11月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

<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11月13日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	△4,565,384,738	
合計	△4,565,384,738	

(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(2023年6月23日から2023年11月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年11月13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	252,426,774,462	—	254,813,452,893	△2,386,678,431
アメリカ・ドル	121,819,138,738	—	122,702,060,904	△882,922,166
イギリス・ポンド	12,517,849,951	—	12,621,204,856	△103,354,905
イスラエル・シェケル	734,463,934	—	765,028,323	△30,564,389
オーストラリア・ドル	3,612,862,662	—	3,613,986,632	△1,123,970
オフショア・人民元	18,583,043,234	—	18,738,927,963	△155,884,729
カナダ・ドル	4,991,143,608	—	5,026,423,723	△35,280,115
シンガポール・ドル	1,086,605,686	—	1,097,284,183	△10,678,497
スウェーデン・クローナ	503,207,330	—	514,796,542	△11,589,212
デンマーク・クローネ	795,431,249	—	806,165,816	△10,734,567
ニュージーランド・ドル	568,314,342	—	573,979,680	△5,665,338
ノルウェー・クローネ	432,558,142	—	435,697,416	△3,139,274
ポーランド・ズロチ	1,287,106,388	—	1,312,168,493	△25,062,105
マレーシア・リンギット	1,269,165,340	—	1,290,907,056	△21,741,716
メキシコ・ペソ	2,273,671,139	—	2,318,996,671	△45,325,532
ユーロ	81,952,212,719	—	82,995,824,635	△1,043,611,916
合計	252,426,774,462	—	254,813,452,893	△2,386,678,431

(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11月13日現在
1口当たり純資産額	1,142,424円
(1万口当たり純資産額)	(11,424,240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11月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/31/25	3,500,000.000	3,244,541.020	
		US T N/B 0.25 06/30/25	5,000,000.000	4,619,824.200	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,000,000.000	2,762,167.980	
		US T N/B 0.25 08/31/25	2,000,000.000	1,834,609.380	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,300,000.000	3,018,339.850	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,500,000.000	4,100,097.640	
		US T N/B 0.375 01/31/26	7,000,000.000	6,331,718.750	
		US T N/B 0.375 04/30/25	3,970,000.000	3,701,327.150	
		US T N/B 0.375 07/31/27	5,100,000.000	4,349,144.540	
		US T N/B 0.375 09/30/27	4,200,000.000	3,557,695.290	
		US T N/B 0.375 11/30/25	4,500,000.000	4,097,460.960	
		US T N/B 0.375 12/31/25	8,400,000.000	7,628,906.200	
		US T N/B 0.5 02/28/26	3,900,000.000	3,527,214.830	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,500,000.000	2,343,115.220	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,200,000.000	1,903,730.460	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,600,000.000	1,379,749.990	
		US T N/B 0.5 06/30/27	3,500,000.000	3,009,316.410	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,900,000.000	3,331,605.450	
		US T N/B 0.5 10/31/27	4,600,000.000	3,903,890.640	

US T N/B 0.625 03/31/27	1,200,000.000	1,046,343.740	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,990,000.000	4,637,570.310	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,000,000.000	2,681,250.000	
US T N/B 0.625 08/15/30	8,090,000.000	6,210,339.050	
US T N/B 0.625 11/30/27	4,000,000.000	3,402,031.230	
US T N/B 0.625 12/31/27	4,660,000.000	3,951,352.350	
US T N/B 0.75 01/31/28	5,070,000.000	4,309,301.960	
US T N/B 0.75 03/31/26	3,140,000.000	2,851,267.200	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,062,000.000	5,484,689.180	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,800,000.000	3,427,125.000	
US T N/B 0.75 08/31/26	6,200,000.000	5,542,945.320	
US T N/B 0.875 06/30/26	5,216,000.000	4,711,311.250	
US T N/B 0.875 09/30/26	6,680,000.000	5,983,818.750	
US T N/B 0.875 11/15/30	9,990,000.000	7,768,005.410	
US T N/B 1.0 07/31/28	5,070,000.000	4,284,546.060	
US T N/B 1.125 02/15/31	5,600,000.000	4,415,468.730	
US T N/B 1.125 02/28/25	4,820,000.000	4,570,244.900	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,000,000.000	890,312.500	
US T N/B 1.125 02/29/28	5,420,000.000	4,673,691.410	
US T N/B 1.125 05/15/40	5,000,000.000	2,865,429.700	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,760,000.000	2,706,506.250	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,770,000.000	3,197,283.980	
US T N/B 1.125 10/31/26	3,600,000.000	3,236,906.230	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,800,000.000	4,150,312.510	
US T N/B 1.25 04/30/28	3,900,000.000	3,363,292.950	
US T N/B 1.25 05/15/50	1,800,000.000	845,050.780	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,640,000.000	3,990,490.610	
US T N/B 1.25 06/30/28	4,870,000.000	4,178,402.920	
US T N/B 1.25 08/15/31	10,200,000.000	7,969,945.330	
US T N/B 1.25 09/30/28	5,200,000.000	4,424,875.000	
US T N/B 1.25 11/30/26	6,000,000.000	5,401,406.280	
US T N/B 1.25 12/31/26	6,000,000.000	5,393,671.860	
US T N/B 1.375 08/15/50	3,500,000.000	1,699,687.500	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,250,000.000	1,137,695.310	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,200,000.000	3,588,539.040	
US T N/B 1.375 11/15/31	9,800,000.000	7,677,304.710	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,330,000.000	2,568,738.680	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,900,000.000	4,165,765.620	
US T N/B 1.5 01/31/27	4,590,000.000	4,145,702.310	
US T N/B 1.5 02/15/30	5,100,000.000	4,229,613.290	
US T N/B 1.5 08/15/26	5,900,000.000	5,392,968.750	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,840,000.000	5,010,081.210	
US T N/B 1.625 02/15/26	3,300,000.000	3,066,937.500	
US T N/B 1.625 05/15/26	4,922,000.000	4,544,774.860	
US T N/B 1.625 05/15/31	10,300,000.000	8,353,460.880	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,800,000.000	3,227,773.420	
US T N/B 1.625 09/30/26	800,000.000	732,281.240	
US T N/B 1.625 10/31/26	3,000,000.000	2,737,734.360	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,200,000.000	2,712,328.110	
US T N/B 1.625 11/30/26	2,100,000.000	1,912,312.500	

US T N/B 1.75 01/31/29	3,600,000.000	3,114,984.380	
US T N/B 1.75 08/15/41	4,400,000.000	2,742,781.270	
US T N/B 1.75 11/15/29	3,500,000.000	2,977,734.370	
US T N/B 1.75 12/31/26	3,500,000.000	3,193,750.000	
US T N/B 1.875 02/15/32	8,500,000.000	6,895,292.980	
US T N/B 1.875 02/15/41	3,800,000.000	2,455,007.810	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,950,000.000	2,761,365.220	
US T N/B 1.875 02/28/27	4,800,000.000	4,380,000.000	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,600,000.000	3,998,046.850	
US T N/B 1.875 06/30/26	1,000,000.000	927,304.690	
US T N/B 1.875 07/31/26	1,000,000.000	924,765.620	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,700,000.000	3,163,277.350	
US T N/B 2.0 02/15/50	2,300,000.000	1,334,539.070	
US T N/B 2.0 08/15/25	3,800,000.000	3,602,949.210	
US T N/B 2.0 08/15/51	3,900,000.000	2,240,595.700	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,700,000.000	4,331,894.540	
US T N/B 2.0 11/15/41	5,500,000.000	3,575,644.540	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,600,000.000	3,441,445.300	
US T N/B 2.125 05/31/26	4,700,000.000	4,391,011.700	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,200,000.000	2,958,124.990	
US T N/B 2.25 02/15/52	5,020,000.000	3,067,690.620	
US T N/B 2.25 03/31/26	6,000,000.000	5,644,453.140	
US T N/B 2.25 05/15/41	5,900,000.000	4,050,027.320	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,100,000.000	3,752,460.950	
US T N/B 2.25 08/15/46	3,100,000.000	1,957,117.170	
US T N/B 2.25 08/15/49	6,440,000.000	3,978,209.400	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,500,000.000	5,208,886.700	
US T N/B 2.25 11/15/27	2,840,000.000	2,585,176.560	
US T N/B 2.375 02/15/42	4,100,000.000	2,835,726.540	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,300,000.000	3,830,107.430	
US T N/B 2.375 04/30/26	3,002,000.000	2,827,039.680	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,100,000.000	4,709,132.830	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,520,000.000	3,127,162.490	
US T N/B 2.375 05/15/51	6,800,000.000	4,294,359.390	
US T N/B 2.375 11/15/49	4,600,000.000	2,922,976.570	
US T N/B 2.5 02/15/45	3,110,000.000	2,106,539.050	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,300,000.000	869,197.260	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,420,000.000	2,292,855.470	
US T N/B 2.5 03/31/27	5,500,000.000	5,118,222.670	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,300,000.000	866,708.980	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,280,000.000	2,168,760.940	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,000,000.000	4,522,265.590	
US T N/B 2.625 03/31/25	200,000.000	193,019.530	
US T N/B 2.625 04/15/25	3,900,000.000	3,761,748.040	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,100,000.000	3,817,884.770	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,900,000.000	3,497,660.160	
US T N/B 2.625 12/31/25	1,400,000.000	1,333,007.810	
US T N/B 2.75 02/15/28	3,900,000.000	3,607,957.030	
US T N/B 2.75 02/28/25	3,010,000.000	2,914,467.770	
US T N/B 2.75 04/30/27	4,740,000.000	4,438,935.960	

US T N/B 2.75 05/15/25	5,500,000.000	5,305,566.420	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,900,000.000	3,532,013.660	
US T N/B 2.75 06/30/25	4,000,000.000	3,851,171.880	
US T N/B 2.75 07/31/27	3,150,000.000	2,937,990.210	
US T N/B 2.75 08/15/32	5,380,000.000	4,647,605.480	
US T N/B 2.75 08/15/42	480,000.000	351,600.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	3,000,000.000	2,081,015.640	
US T N/B 2.75 08/31/25	3,000,000.000	2,878,828.140	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,130,000.000	823,708.200	
US T N/B 2.75 11/15/47	1,900,000.000	1,316,900.380	
US T N/B 2.875 04/30/25	3,920,000.000	3,790,839.050	
US T N/B 2.875 04/30/29	2,900,000.000	2,647,156.250	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,840,000.000	3,557,549.990	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,900,000.000	7,793,757.760	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,790,000.000	1,324,669.910	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,100,000.000	2,193,492.170	
US T N/B 2.875 05/15/52	3,900,000.000	2,753,460.910	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,300,000.000	2,221,970.700	
US T N/B 2.875 06/15/25	2,000,000.000	1,929,765.620	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,270,000.000	3,149,993.550	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,900,000.000	5,445,630.850	
US T N/B 2.875 08/15/45	2,000,000.000	1,444,726.560	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,000,000.000	714,785.160	
US T N/B 2.875 11/30/25	11,140,000.000	10,676,123.490	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,590,000.000	1,161,414.250	
US T N/B 3.0 02/15/48	3,100,000.000	2,251,919.910	
US T N/B 3.0 02/15/49	6,500,000.000	4,711,230.480	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,000,000.000	765,468.750	
US T N/B 3.0 05/15/45	2,600,000.000	1,926,437.500	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,300,000.000	948,085.940	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,000,000.000	2,897,226.570	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,910,000.000	2,836,200.950	
US T N/B 3.0 08/15/52	3,140,000.000	2,277,849.220	
US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,925,703.120	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,000,000.000	1,923,593.760	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,500,000.000	1,116,093.750	
US T N/B 3.0 11/15/45	670,000.000	493,889.450	
US T N/B 3.125 02/15/42	500,000.000	391,992.190	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,260,000.000	974,211.320	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,520,000.000	1,873,659.350	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,000,000.000	2,900,214.840	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,500,000.000	1,905,029.300	
US T N/B 3.125 08/31/27	4,100,000.000	3,872,097.640	
US T N/B 3.125 08/31/29	2,500,000.000	2,301,367.200	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,900,000.000	4,558,722.640	
US T N/B 3.125 11/15/41	580,000.000	456,296.870	
US T N/B 3.25 05/15/42	2,650,000.000	2,106,439.440	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,890,000.000	3,698,994.920	
US T N/B 3.25 06/30/29	2,500,000.000	2,320,996.100	
US T N/B 3.375 05/15/33	6,000,000.000	5,423,906.270	

US T N/B 3.375 05/15/44	1,400,000.000	1,113,492.180	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,300,000.000	1,858,867.170	
US T N/B 3.375 11/15/48	8,450,000.000	6,576,641.590	
US T N/B 3.5 01/31/28	2,900,000.000	2,767,460.940	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,300,000.000	2,151,847.660	
US T N/B 3.5 02/15/33	5,500,000.000	5,030,136.690	
US T N/B 3.5 02/15/39	890,000.000	766,616.790	
US T N/B 3.5 04/30/28	3,300,000.000	3,144,667.960	
US T N/B 3.5 04/30/30	2,500,000.000	2,334,960.950	
US T N/B 3.5 09/15/25	2,500,000.000	2,430,468.750	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,700,000.000	1,409,904.290	
US T N/B 3.625 02/15/53	1,700,000.000	1,397,984.370	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,353,984.370	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,500,000.000	2,353,271.470	
US T N/B 3.625 05/15/26	4,800,000.000	4,657,312.510	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,950,000.000	3,248,875.000	
US T N/B 3.625 05/31/28	3,150,000.000	3,017,109.370	
US T N/B 3.625 08/15/43	800,000.000	665,859.370	
US T N/B 3.75 04/15/26	2,600,000.000	2,530,937.500	
US T N/B 3.75 05/31/30	3,000,000.000	2,841,503.910	
US T N/B 3.75 06/30/30	3,500,000.000	3,313,378.910	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	864,316.410	
US T N/B 3.75 11/15/43	2,500,000.000	2,117,578.120	
US T N/B 3.875 01/15/26	2,600,000.000	2,540,585.940	
US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,034,609.370	
US T N/B 3.875 03/31/25	2,000,000.000	1,962,812.500	
US T N/B 3.875 04/30/25	3,900,000.000	3,825,503.910	
US T N/B 3.875 05/15/43	3,200,000.000	2,771,249.980	
US T N/B 3.875 08/15/33	10,500,000.000	9,879,843.750	
US T N/B 3.875 08/15/40	700,000.000	619,691.400	
US T N/B 3.875 09/30/29	4,200,000.000	4,022,156.240	
US T N/B 3.875 11/30/27	4,600,000.000	4,458,226.570	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,500,000.000	2,391,796.870	
US T N/B 3.875 12/31/27	2,600,000.000	2,519,257.800	
US T N/B 3.875 12/31/29	3,500,000.000	3,346,191.410	
US T N/B 4.0 02/15/26	6,500,000.000	6,366,826.180	
US T N/B 4.0 02/28/30	4,500,000.000	4,329,316.390	
US T N/B 4.0 02/29/28	3,700,000.000	3,600,707.020	
US T N/B 4.0 06/30/28	2,600,000.000	2,528,246.080	
US T N/B 4.0 07/31/30	3,500,000.000	3,361,914.080	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,200,000.000	2,120,507.810	
US T N/B 4.0 11/15/42	4,000,000.000	3,536,093.760	
US T N/B 4.0 11/15/52	3,770,000.000	3,323,932.430	
US T N/B 4.0 12/15/25	3,900,000.000	3,822,000.000	
US T N/B 4.125 06/15/26	5,000,000.000	4,908,203.100	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,443,554.700	
US T N/B 4.125 08/15/53	5,000,000.000	4,508,203.100	
US T N/B 4.125 08/31/30	3,000,000.000	2,902,031.250	
US T N/B 4.125 09/30/27	3,000,000.000	2,936,132.820	
US T N/B 4.125 10/31/27	4,000,000.000	3,913,593.760	

	US T N/B 4.125 11/15/32	8,300,000.000	7,978,050.800	
	US T N/B 4.25 05/15/39	850,000.000	798,701.170	
	US T N/B 4.25 05/31/25	3,500,000.000	3,450,644.540	
	US T N/B 4.25 10/15/25	8,370,000.000	8,245,103.860	
	US T N/B 4.25 11/15/40	800,000.000	741,562.490	
	US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	579,468.750	
	US T N/B 4.375 05/15/40	800,000.000	756,343.750	
	US T N/B 4.375 05/15/41	870,000.000	816,848.430	
	US T N/B 4.375 08/15/26	6,200,000.000	6,121,289.070	
	US T N/B 4.375 08/15/43	4,500,000.000	4,178,671.870	
	US T N/B 4.375 11/15/39	2,700,000.000	2,562,574.210	
	US T N/B 4.5 02/15/36	750,000.000	744,287.100	
	US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	585,773.430	
	US T N/B 4.5 07/15/26	3,900,000.000	3,864,351.580	
	US T N/B 4.5 08/15/39	1,030,000.000	993,708.580	
	US T N/B 4.5 11/15/25	10,200,000.000	10,095,609.320	
	US T N/B 4.625 02/15/40	1,000,000.000	975,976.560	
	US T N/B 4.625 02/28/25	6,300,000.000	6,246,597.670	
	US T N/B 4.625 03/15/26	4,732,000.000	4,698,912.950	
	US T N/B 4.625 06/30/25	3,000,000.000	2,974,570.320	
	US T N/B 4.625 09/15/26	4,000,000.000	3,977,187.520	
	US T N/B 4.625 10/15/26	5,000,000.000	4,971,875.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,020,000.000	1,005,058.590	
	US T N/B 4.75 07/31/25	2,900,000.000	2,881,591.780	
	US T N/B 5.0 05/15/37	400,000.000	414,140.620	
	US T N/B 5.0 10/31/25	8,000,000.000	7,992,343.760	
	US T N/B 5.25 11/15/28	800,000.000	818,093.750	
	US T N/B 5.375 02/15/31	500,000.000	522,695.310	
	US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	1,847,401.930	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,000,000.000	1,049,140.620	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,000,000.000	1,085,546.880	
アメリカ・ドル	小計	936,234,000.000 (142,036,060,140)	813,107,467.830 (123,356,533,949)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,010,000.000	921,907.390	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,680,000.000	1,418,923.630	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,600,000.000	1,186,915.200	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,750,000.000	2,454,666.500	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,800,000.000	1,393,115.980	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,550,000.000	1,282,034.450	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,480,000.000	414,992.000	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,400,000.000	1,318,467.360	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,250,000.000	815,900.000	
	UK TREASURY 0.625	1,000,000.000	380,317.200	

10/22/50			
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,810,000.000	854,030.400	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,200,000.000	1,600,891.600	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,650,000.000	1,368,916.230	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,900,000.000	2,252,401.000	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	2,100,000.000	1,300,826.940	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	570,000.000	198,608.290	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,210,000.000	1,089,060.500	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,680,000.000	783,384.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,630,000.000	955,554.900	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,190,000.000	2,036,389.020	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,700,000.000	917,849.720	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	890,000.000	434,400.100	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,520,000.000	1,350,983.600	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,000,000.000	500,390.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	750,000.000	333,600.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	760,000.000	427,355.600	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,300,000.000	662,735.320	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,900,000.000	1,353,873.500	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,270,000.000	2,169,643.300	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	900,000.000	552,033.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,300,000.000	1,046,630.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,760,000.000	2,538,631.440	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,220,000.000	1,013,820.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,770,000.000	1,405,946.400	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	3,750,000.000	3,672,562.500	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,000,000.000	909,136.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	670,000.000	565,784.580	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	2,100,000.000	1,763,034.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,540,000.000	1,361,332.580	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	1,250,000.000	1,100,625.000	
UK TREASURY 4.125	2,600,000.000	2,578,354.480	

	01/29/27			
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,650,000.000	1,613,370.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	1,855,009.800	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,270,000.000	1,212,788.270	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,050,000.000	1,050,745.290	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,000,000.000	948,242.600	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,690,000.000	1,565,929.660	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,750,000.000	1,613,199.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,130,000.000	1,041,996.500	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	700,000.000	705,662.020	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,000,000.000	1,007,700.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,820,000.000	1,767,868.640	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	700,000.000	712,719.840	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,300,000.000	1,346,049.640	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	810,000.000	821,591.100	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	800,000.000	865,055.200	
	イギリス・ポンド 小計	84,930,000.000 (15,750,268,500)	68,813,951.270 (12,761,547,263)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	3,400,000.000	3,148,168.800	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,830,000.000	1,743,089.640	
	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	500,000.000	493,102.500	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,810,000.000	1,494,902.530	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,380,000.000	1,091,591.040	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,785,000.000	1,234,839.790	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	1,730,000.000	1,665,823.920	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	850,000.000	575,744.950	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,700,000.000	1,598,164.900	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,040,000.000	961,109.760	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	2,100,000.000	1,783,036.500	

	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,475,000.000	1,625,262.670	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,030,000.000	2,162,260.590	
イスラエル・シユケル 小計		21,630,000.000 (849,226,245)	19,577,097.590 (768,626,217)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,600,000.000	1,475,957.320	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	2,320,000.000	2,089,314.740	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,770,000.000	2,115,729.670	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	2,210,000.000	1,747,101.940	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,350,000.000	1,803,842.650	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,370,000.000	1,914,176.000	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,350,000.000	702,030.300	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,400,000.000	1,108,030.140	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,600,000.000	1,468,082.470	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,140,000.000	1,908,443.130	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,550,000.000	1,156,563.070	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	800,000.000	663,287.200	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,120,000.000	1,058,166.690	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,000,000.000	930,459.550	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,010,000.000	923,475.870	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	760,000.000	552,960.350	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,650,000.000	1,437,874.090	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,940,000.000	1,909,615.390	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,800,000.000	1,705,742.520	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	630,000.000	520,314.660	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,680,000.000	1,513,852.610	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	630,000.000	567,777.720	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,600,000.000	1,483,754.860	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,230,000.000	3,230,750.320		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,210,000.000	1,200,604.020		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,770,000.000	1,798,696.120		
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	900,000.000	870,015.430		
オーストラリア・ドル 小計		43,390,000.000 (4,180,626,500)	37,856,618.830 (3,647,485,224)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 04/09/25	38,500,000.000	38,290,885.710	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	7,500,000.000	7,448,836.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	4,500,000.000	4,490,454.150	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	12,500,000.000	12,497,974.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	9,000,000.000	8,977,027.680	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	47,000,000.000	46,795,831.060	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.46 02/15/26	49,000,000.000	49,076,621.300	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	4,400,000.000	4,401,542.640	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28	8,000,000.000	7,992,923.920	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	10,500,000.000	10,506,038.550	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	11,000,000.000	10,914,119.810	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	21,000,000.000	20,947,112.760	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	33,000,000.000	33,164,841.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	10,000,000.000	9,990,522.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	12,000,000.000	12,010,738.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.64 01/15/28	19,000,000.000	19,131,297.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	42,500,000.000	42,579,768.250	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	3,000,000.000	3,023,094.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	11,500,000.000	11,491,840.290	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	22,000,000.000	22,103,538.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	6,100,000.000	6,149,285.560	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	55,000,000.000	55,291,450.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	39,000,000.000	39,363,062.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	17,000,000.000	17,175,511.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	20,500,000.000	20,702,833.150	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	36,000,000.000	36,492,865.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	13,000,000.000	13,242,058.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	7,000,000.000	7,112,356.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	9,000,000.000	9,166,383.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	17,000,000.000	17,401,851.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	9,500,000.000	9,767,249.250	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25	55,500,000.000	56,312,858.550	
CHINA GOVERNMENT BOND	94,200,000.000	95,783,172.300	

	3.03 03/11/26			
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.000	6,871,946.120	
	3.25 06/06/26			
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,500,000.000	17,079,801.750	
	3.28 12/03/27			
	CHINA GOVERNMENT BOND	600,000.000	632,802.780	
	3.32 04/15/52			
	CHINA GOVERNMENT BOND	28,600,000.000	30,418,699.740	
	3.39 03/16/50			
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.000	2,251,390.800	
	3.72 04/12/51			
	CHINA GOVERNMENT BOND	43,500,000.000	49,604,498.550	
	3.81 09/14/50			
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,400,000.000	3,901,123.280	
	3.86 07/22/49			
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.000	11,857,669.000	
	4.08 10/22/48			
	オフショア・人民元 小計	866,000,000.000 (17,974,955,800)	882,413,880.500 (18,315,647,228)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	2,000,000.000	1,821,148.930	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,250,000.000	1,162,764.530	
	CANADA 0.5 12/01/30	3,000,000.000	2,380,013.540	
	CANADA 1.0 06/01/27	710,000.000	639,844.350	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,760,000.000	1,611,179.580	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	669,199.230	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,050,000.000	957,181.160	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,590,000.000	1,350,162.090	
	CANADA 1.5 04/01/25	830,000.000	793,719.170	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	746,993.170	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,050,000.000	1,732,999.110	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,850,000.000	2,386,196.830	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,090,000.000	1,380,950.930	
	CANADA 2.0 06/01/28	500,000.000	460,998.030	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,300,000.000	1,124,285.200	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,580,000.000	1,840,443.040	
	CANADA 2.25 06/01/25	560,000.000	539,949.440	
	CANADA 2.25 06/01/29	460,000.000	423,861.020	
	CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	458,000.700	
	CANADA 2.5 12/01/32	2,620,000.000	2,348,125.740	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,060,000.000	967,548.620	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,700,000.000	1,622,034.030	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,000,000.000	852,221.830	
	CANADA 2.75 12/01/55	1,000,000.000	832,393.780	
	CANADA 2.75 12/01/64	580,000.000	475,595.590	
	CANADA 3.0 04/01/26	750,000.000	726,491.430	
	CANADA 3.0 10/01/25	600,000.000	583,272.430	
	CANADA 3.0 11/01/24	10,000.000	9,813.400	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,800,000.000	1,746,232.830	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,600,000.000	1,523,368.720	
	CANADA 3.5 03/01/28	800,000.000	784,270.040	

	CANADA 3.5 08/01/25	1,000,000.000	980,905.470	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,110,000.000	1,075,490.480	
	CANADA 3.75 02/01/25	2,000,000.000	1,973,672.460	
	CANADA 3.75 05/01/25	1,000,000.000	985,725.130	
	CANADA 4.0 06/01/41	420,000.000	432,630.850	
	CANADA 4.5 11/01/25	3,000,000.000	2,996,388.300	
	CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	435,997.480	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,250,000.000	1,366,736.580	
	CANADA 5.75 06/01/33	670,000.000	770,066.420	
カナダ・ドル 小計		50,940,000.000 (5,596,268,400)	45,968,871.660 (5,050,140,241)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	440,000.000	415,511.800	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	600,000.000	565,500.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	490,000.000	441,000.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	810,000.000	647,386.900	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	320,000.000	257,046.400	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	910,000.000	883,155.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	730,000.000	665,760.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	648,000.000	635,947.200	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	340,000.000	310,833.100	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	520,000.000	509,444.000	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	330,000.000	317,790.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	540,000.000	515,207.480	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	575,000.000	550,858.620	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	550,000.000	543,400.000	
	SINGAPORE 2.875 08/01/28	150,000.000	148,656.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	198,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	700,000.000	690,200.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	325,000.000	338,975.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	650,000.000	665,538.250	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	670,000.000	675,494.000		
シンガポール・ドル 小計		10,498,000.000 (1,170,736,960)	9,976,103.750 (1,112,535,090)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	3,300,000.000	2,709,498.000	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	7,980,000.000	7,270,154.900	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	5,300,000.000	4,703,993.100	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,700,000.000	4,423,833.020	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,220,000.000	2,918,853.960	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,600,000.000	4,400,785.040	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,550,000.000	6,455,526.730	
SWEDEN 3.5 03/30/39	3,430,000.000	3,656,654.400		
スウェーデン・クローナ 小計		39,080,000.000 (543,602,800)	36,539,299.150 (508,261,651)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,830,000.000	2,734,873.220	
	DENMARK 0.0 11/15/31	5,410,000.000	4,320,155.500	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,880,000.000	2,316,066.540	
	DENMARK 0.5 11/15/27	5,130,000.000	4,689,247.320	

	DENMARK 0.5 11/15/29	4,570,000.000	3,999,758.140	
	DENMARK 1.75 11/15/25	6,870,000.000	6,694,540.200	
	DENMARK 2.25 11/15/33	2,350,000.000	2,208,880.150	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,290,000.000	9,758,377.020	
デンマーク・クローネ 小計		40,330,000.000 (876,370,900)	36,721,898.090 (797,966,845)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	920,000.000	746,965.360	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	1,280,000.000	1,144,673.020	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	560,000.000	435,848.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	570,000.000	341,865.530	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	717,874.580	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	120,000.000	115,833.780	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	340,000.000	258,860.440	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	500,000.000	321,965.530	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	710,000.000	643,875.530	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	590,000.000	519,482.160	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	420,000.000	389,711.310	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	550,000.000	541,902.180	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	340,000.000	330,202.500	
ニュージーランド・ドル 小計		7,810,000.000 (697,511,100)	6,509,059.920 (581,324,141)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,890,000.000	1,563,181.200	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,610,000.000	3,091,268.270	
	NORWAY 1.5 02/19/26	7,400,000.000	6,992,075.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,950,000.000	3,680,215.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,480,000.000	1,433,171.320	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,920,000.000	3,497,404.400	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,560,000.000	2,364,134.400	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,650,000.000	2,323,620.700	
	NORWAY 3.0 08/15/33	5,290,000.000	4,927,582.100	
NORWAY 3.5 10/06/42	1,650,000.000	1,629,299.100		
ノルウェー・クローネ 小計		34,400,000.000 (469,216,000)	31,501,951.490 (429,686,618)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,400,000.000	2,079,748.800	
	POLAND 0.75 04/25/25	2,150,000.000	2,017,293.400	
	POLAND 1.25 10/25/30	1,900,000.000	1,459,321.600	
	POLAND 1.75 04/25/32	2,350,000.000	1,758,570.800	
	POLAND 10/25/25	1,000,000.000	907,761.360	
	POLAND 2.5 07/25/26	5,980,000.000	5,574,316.800	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,900,000.000	3,540,225.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,810,000.000	1,628,744.790	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,500,000.000	2,178,790.000	

	POLAND 3.25 07/25/25	1,700,000.000	1,644,546.000	
	POLAND 3.75 05/25/27	1,770,000.000	1,684,121.370	
	POLAND 5.75 04/25/29	4,050,000.000	4,105,671.300	
	POLAND 6.0 10/25/33	2,670,000.000	2,748,422.430	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,700,000.000	4,011,249.550	
ポーランド・ズロチ 小計		37,880,000.000 (1,386,097,384)	35,338,783.200 (1,293,109,687)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	915,082.770	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,200,000.000	1,190,945.500	
	MALAYSIA 3.519 04/20/28	2,100,000.000	2,084,971.600	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,100,000.000	1,066,622.330	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	1,100,000.000	1,095,883.770	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	2,300,000.000	2,153,700.650	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,300,000.000	1,270,015.160	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,110,000.000	2,091,728.030	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,230,000.000	1,229,250.470	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	370,000.000	372,661.330	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,400,000.000	1,409,806.300	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,390,000.000	1,400,936.240	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,570,000.000	1,585,643.790	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,000,000.000	2,018,206.600	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	2,110,000.000	1,997,779.810	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	800,000.000	813,891.680	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	2,050,000.000	2,091,743.330	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	2,000,000.000	2,034,938.200	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,320,000.000	1,334,457.690	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,500,000.000	2,583,384.000	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	720,000.000	740,358.720	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	740,000.000	785,028.400	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,300,000.000	1,374,812.010	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	700,000.000	734,239.520	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,276,831.320	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	2,230,000.000	2,426,279.690	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,700,000.000	1,830,060.880		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	620,000.000	672,103.370		
マレーシア・リンギット 小計		40,160,000.000 (1,293,348,784)	40,581,363.160 (1,306,918,742)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	2,000,000.000	1,913,480.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	40,200,000.000	35,398,914.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	13,340,000.000	12,452,890.000	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	2,000,000.000	1,774,209.840	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	21,330,000.000	18,498,869.100	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	12,750,000.000	10,641,405.000	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	29,000,000.000	26,846,750.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	4,700,000.000	4,817,688.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	6,500,000.000	6,436,112.150	
	MEXICAN BONDS 5.75	24,100,000.000	21,907,088.460	

	03/05/26			
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	19,500,000.000	18,158,595.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,370,000.000	27,325,407.500	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	28,700,000.000	23,730,882.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	10,891,000.000	9,498,803.470	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	17,946,000.000	15,055,078.860	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	24,201,000.000	23,101,306.560	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,800,000.000	10,654,102.000	
	メキシコ・ペソ 小計	299,328,000.000 (2,572,634,362)	268,211,581.940 (2,305,198,083)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,550,000.000	1,275,536.850	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,280,000.000	1,016,765.440	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	630,000.000	600,955.110	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	900,000.000	774,774.900	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	400,000.000	221,920.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	600,000.000	400,440.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,200,000.000	1,051,142.400	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	800,000.000	734,356.000	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	210,000.000	82,623.240	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	850,000.000	773,576.500	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	400,000.000	208,318.800	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,520,000.000	1,422,707.840	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	350,000.000	137,768.750	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	650,000.000	540,164.300	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	900,000.000	867,270.600	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	950,000.000	643,335.250	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	900,000.000	472,230.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	200,000.000	143,586.000	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	720,000.000	700,235.280	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	400,000.000	260,889.600	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	510,000.000	467,522.130	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,250,000.000	1,210,140.000	
	AUSTRIA 2.9 05/23/29	100,000.000	99,337.500	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	570,000.000	537,989.940	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	100,000.000	92,355.800	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	380,000.000	399,137.560	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,400,000.000	1,495,588.780	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	500,000.000	519,033.550	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,000,000.000	1,109,582.000	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,000,000.000	890,868.000	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	1,500,000.000	1,167,550.500	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	900,000.000	741,915.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	750,000.000	588,525.000	

BELGIUM 0.4 06/22/40	860,000.000	512,214.280	
BELGIUM 0.65 06/22/71	70,000.000	25,754.120	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,300,000.000	1,250,561.130	
BELGIUM 0.8 06/22/27	800,000.000	741,352.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,400,000.000	1,268,960.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,950,000.000	1,740,969.750	
BELGIUM 1.0 06/22/26	2,300,000.000	2,183,647.020	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,310,000.000	1,120,947.350	
BELGIUM 1.25 04/22/33	1,000,000.000	839,064.000	
BELGIUM 1.4 06/22/53	680,000.000	391,360.400	
BELGIUM 1.45 06/22/37	800,000.000	619,569.600	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	608,699.600	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,230,000.000	798,503.700	
BELGIUM 1.9 06/22/38	400,000.000	322,356.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	600,000.000	401,940.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	550,000.000	391,082.450	
BELGIUM 2.75 04/22/39	300,000.000	268,585.200	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,168,734.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	840,000.000	811,692.840	
BELGIUM 3.3 06/22/54	1,200,000.000	1,076,820.000	
BELGIUM 3.45 06/22/43	800,000.000	763,856.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	800,000.000	795,818.400	
BELGIUM 4.0 03/28/32	650,000.000	687,274.250	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,000,000.000	1,069,797.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	700,000.000	722,183.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,680,000.000	1,920,834.720	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,610,000.000	1,778,718.340	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,880,000.000	3,622,251.600	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,470,000.000	1,404,568.270	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,990,000.000	1,815,274.020	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	3,500,000.000	3,228,085.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,500,000.000	2,359,200.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	500,000.000	472,460.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,710,000.000	2,573,117.900	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	500,000.000	474,720.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,100,000.000	2,059,470.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,300,000.000	2,273,481.000	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	500,000.000	493,120.000	
BUNDESSCHAT 2.8 06/12/25	1,300,000.000	1,290,653.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,810,000.000	1,543,115.500	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,000,000.000	1,660,760.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,680,000.000	1,356,420.240	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,270,000.000	924,369.500	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,300,000.000	1,617,337.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,800,000.000	2,357,656.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	520,000.000	438,214.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,800,000.000	1,474,452.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	600,000.000	491,761.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,320,000.000	1,092,151.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,070,000.000	506,452.400	

DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,560,000.000	693,981.600	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,800,000.000	1,620,324.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,700,000.000	1,495,102.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,500,000.000	2,308,375.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,850,000.000	1,640,245.150	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,250,000.000	2,015,460.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,050,000.000	1,013,344.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,800,000.000	4,547,856.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,660,000.000	1,519,099.200	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,100,000.000	1,939,100.150	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,300,000.000	2,130,509.940	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,950,000.000	2,547,139.150	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,150,000.000	891,664.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,000,000.000	2,891,520.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	3,200,000.000	2,282,009.600	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,600,000.000	2,410,616.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,370,000.000	1,070,120.700	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,500,000.000	1,170,810.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,300,000.000	2,234,013.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	3,360,000.000	3,259,536.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	900,000.000	873,378.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,000,000.000	984,580.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,150,000.000	2,005,068.500	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,750,000.000	2,557,612.750	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	2,000,000.000	1,982,380.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,050,000.000	1,093,890.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,650,000.000	2,974,397.100	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,690,000.000	1,966,467.100	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,000,000.000	1,090,450.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,880,000.000	2,222,216.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,800,000.000	2,227,644.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,590,000.000	1,883,704.800	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,550,000.000	1,726,204.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,500,000.000	1,806,075.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	970,000.000	1,092,433.400	
FINLAND 0.0 09/15/26	100,000.000	91,680.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	380,000.000	308,007.100	
FINLAND 0.125 04/15/36	390,000.000	260,814.840	
FINLAND 0.125 04/15/52	380,000.000	157,206.600	

FINLAND 0. 125 09/15/31	480,000.000	379,600.320	
FINLAND 0. 25 09/15/40	400,000.000	236,795.400	
FINLAND 0. 5 04/15/26	900,000.000	847,782.000	
FINLAND 0. 5 04/15/43	300,000.000	173,997.000	
FINLAND 0. 5 09/15/27	300,000.000	273,068.700	
FINLAND 0. 5 09/15/28	500,000.000	443,248.000	
FINLAND 0. 5 09/15/29	400,000.000	346,049.840	
FINLAND 0. 75 04/15/31	200,000.000	168,826.000	
FINLAND 0. 875 09/15/25	850,000.000	815,319.570	
FINLAND 1. 125 04/15/34	500,000.000	405,538.000	
FINLAND 1. 375 04/15/27	200,000.000	189,286.200	
FINLAND 1. 375 04/15/47	440,000.000	296,164.000	
FINLAND 1. 5 09/15/32	390,000.000	338,912.340	
FINLAND 2. 625 07/04/42	470,000.000	415,222.060	
FINLAND 2. 75 04/15/38	200,000.000	182,800.000	
FINLAND 2. 75 07/04/28	700,000.000	692,262.900	
FINLAND 2. 875 04/15/29	500,000.000	494,550.000	
FINLAND 3. 0 09/15/33	500,000.000	488,242.000	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/25	70,000.000	67,076.530	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/26	3,500,000.000	3,263,837.500	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/27	3,800,000.000	3,446,508.800	
FRANCE OAT 0. 0 05/25/32	3,800,000.000	2,911,560.000	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/29	4,560,000.000	3,810,728.160	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/30	3,200,000.000	2,586,880.000	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/31	3,400,000.000	2,653,978.800	
FRANCE OAT 0. 25 11/25/26	2,300,000.000	2,117,117.800	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/25	3,600,000.000	3,452,441.400	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/26	3,630,000.000	3,405,486.230	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/29	4,720,000.000	4,124,883.520	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/40	2,110,000.000	1,300,089.160	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/72	930,000.000	308,406.040	
FRANCE OAT 0. 5 06/25/44	970,000.000	529,888.690	
FRANCE OAT 0. 75 02/25/28	4,330,000.000	3,942,980.270	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/28	5,200,000.000	4,710,440.800	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/52	1,750,000.000	846,119.750	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/53	1,700,000.000	802,015.800	
FRANCE OAT 0. 75 11/25/28	3,290,000.000	2,949,014.530	
FRANCE OAT 1. 0 05/25/27	2,370,000.000	2,212,456.620	
FRANCE OAT 1. 0 11/25/25	6,100,000.000	5,843,763.400	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/34	2,600,000.000	2,127,154.450	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/36	2,640,000.000	2,051,280.000	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/38	950,000.000	701,670.000	
FRANCE OAT 1. 5 05/25/31	5,600,000.000	5,012,744.800	
FRANCE OAT 1. 5 05/25/50	3,260,000.000	2,049,904.300	
FRANCE OAT 1. 75 05/25/66	660,000.000	397,290.300	
FRANCE OAT 1. 75 06/25/39	2,660,000.000	2,095,736.860	
FRANCE OAT 2. 0 05/25/48	1,800,000.000	1,307,302.200	
FRANCE OAT 2. 0 11/25/32	3,100,000.000	2,811,299.320	
FRANCE OAT 2. 5 05/25/30	3,400,000.000	3,293,141.060	
FRANCE OAT 2. 5 05/25/43	1,000,000.000	834,309.000	

FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,500,000.000	4,428,319.500	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,200,000.000	3,154,822.400	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,790,000.000	4,745,601.490	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,300,000.000	3,235,560.900	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,150,000.000	986,981.750	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,300,000.000	3,085,311.900	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,320,000.000	4,360,677.120	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	2,000,000.000	2,035,920.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,300,000.000	2,394,374.750	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,090,000.000	2,186,280.030	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,600,000.000	1,683,443.200	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,210,000.000	3,570,810.420	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,950,000.000	3,327,004.100	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,700,000.000	4,149,520.400	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,290,000.000	3,935,099.910	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,470,000.000	6,808,044.560	
IRISH 0.0 10/18/31	1,000,000.000	786,781.000	
IRISH 0.2 05/15/27	900,000.000	818,097.300	
IRISH 0.2 10/18/30	400,000.000	329,308.800	
IRISH 0.35 10/18/32	400,000.000	314,950.800	
IRISH 0.4 05/15/35	550,000.000	400,094.200	
IRISH 0.55 04/22/41	330,000.000	204,016.230	
IRISH 0.9 05/15/28	650,000.000	594,483.370	
IRISH 1.0 05/15/26	2,050,000.000	1,949,955.490	
IRISH 1.1 05/15/29	950,000.000	859,594.200	
IRISH 1.3 05/15/33	280,000.000	237,774.320	
IRISH 1.35 03/18/31	300,000.000	267,093.600	
IRISH 1.5 05/15/50	770,000.000	494,785.830	
IRISH 1.7 05/15/37	450,000.000	366,268.500	
IRISH 2.0 02/18/45	900,000.000	686,981.700	
IRISH 2.4 05/15/30	500,000.000	480,941.620	
IRISH 3.0 10/18/43	270,000.000	252,252.360	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,250,000.000	1,146,125.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,400,000.000	2,173,920.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	2,030,000.000	1,743,364.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,700,000.000	1,420,690.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,400,000.000	1,306,078.660	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,000,000.000	858,300.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,100,000.000	841,283.850	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	2,400,000.000	2,196,720.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,300,000.000	1,826,193.100	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.000	635,800.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,200,000.000	916,320.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.000	979,560.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	2,400,000.000	2,161,680.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,400,000.000	1,088,872.400	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,700,000.000	1,559,835.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,600,000.000	1,532,048.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,210,000.000	1,125,729.550	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,700,000.000	1,442,621.700	

ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,100,000.000	773,630.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	2,830,000.000	2,739,117.380	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,040,000.000	584,064.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,400,000.000	2,320,677.600	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,190,000.000	1,130,857.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,600,000.000	2,131,256.400	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,600,000.000	1,356,865.600	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,400,000.000	756,319.200	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	900,000.000	583,380.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,260,000.000	1,223,082.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,400,000.000	1,303,117.200	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	2,805,938.500	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,100,000.000	1,036,141.700	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	3,400,000.000	3,264,302.600	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	400,000.000	211,400.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	680,000.000	400,792.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,950,000.000	1,852,695.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,600,000.000	1,230,880.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,380,000.000	2,011,656.920	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	780,000.000	506,220.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	4,000,000.000	3,911,404.710	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,200,000.000	1,036,440.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,100,000.000	1,053,690.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,280,000.000	902,400.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	447,020.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.000	940,800.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,100,000.000	1,997,268.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,380,000.000	1,111,176.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,400,000.000	1,331,141.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	800,000.000	644,735.600	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	530,000.000	446,737.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,440,000.000	1,126,072.800	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,500,000.000	1,334,638.500	
ITALY BTPS 3.4 03/28/25	1,100,000.000	1,094,610.000	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,050,000.000	1,034,775.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,660,000.000	1,332,017.200	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,300,000.000	1,295,970.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,760,000.000	2,678,292.960	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	900,000.000	878,400.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	2,400,000.000	2,406,912.000	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	2,200,000.000	2,192,520.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,400,000.000	1,191,057.000	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,600,000.000	1,606,080.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	2,000,000.000	1,978,000.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,080,000.000	1,946,256.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,300,000.000	1,232,400.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	700,000.000	689,010.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	990,000.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	800,000.000	805,280.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,000,000.000	975,000.000	

ITALY BTPS 4.35 11/01/33	1,330,000.000	1,319,094.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,140,000.000	1,140,912.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,300,000.000	1,221,350.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,400,000.000	1,424,220.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	500,000.000	464,500.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,400,000.000	1,454,152.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.000	1,371,125.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,830,000.000	1,901,187.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,360,000.000	2,404,132.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,290,000.000	1,310,511.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,740,000.000	1,855,362.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,120,000.000	2,339,632.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,800,000.000	3,132,360.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,470,000.000	1,615,824.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	900,000.000	988,380.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	1,300,000.000	1,217,079.500	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,500,000.000	1,369,360.800	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,000,000.000	863,421.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	700,000.000	447,648.600	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,500,000.000	640,824.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	900,000.000	744,184.800	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	780,000.000	625,403.460	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,600,000.000	1,524,286.080	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	700,000.000	604,956.800	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,470,000.000	974,964.270	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,400,000.000	1,311,800.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,400,000.000	1,138,906.130	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,350,000.000	1,250,710.200	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,344,371.020	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	570,000.000	443,949.170	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	1,000,000.000	976,674.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,520,000.000	1,462,550.080	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	700,000.000	668,665.900	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,440,000.000	1,346,506.560	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	700,000.000	707,200.580	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,300,000.000	1,398,436.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,500,000.000	1,633,500.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	670,000.000	738,340.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	2,600,000.000	2,417,391.600	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,400,000.000	1,260,350.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,600,000.000	1,399,040.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	1,800,000.000	1,706,596.380	
SPAIN 0.1 04/30/31	2,490,000.000	1,938,465.000	

	SPAIN 0.5 04/30/30	2,700,000.000	2,249,100.000	
	SPAIN 0.5 10/31/31	1,300,000.000	1,028,632.800	
	SPAIN 0.6 10/31/29	2,310,000.000	1,966,978.860	
	SPAIN 0.7 04/30/32	1,300,000.000	1,029,594.800	
	SPAIN 0.8 07/30/27	1,300,000.000	1,189,825.000	
	SPAIN 0.8 07/30/29	1,500,000.000	1,303,125.000	
	SPAIN 0.85 07/30/37	1,060,000.000	708,603.640	
	SPAIN 1.0 07/30/42	1,400,000.000	823,760.000	
	SPAIN 1.0 10/31/50	1,310,000.000	629,137.980	
	SPAIN 1.2 10/31/40	1,850,000.000	1,187,234.720	
	SPAIN 1.25 10/31/30	1,500,000.000	1,302,450.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	2,640,000.000	2,494,119.590	
	SPAIN 1.4 04/30/28	2,600,000.000	2,397,382.000	
	SPAIN 1.4 07/30/28	2,400,000.000	2,208,120.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	2,230,000.000	2,020,918.340	
	SPAIN 1.45 10/31/27	2,300,000.000	2,144,217.800	
	SPAIN 1.45 10/31/71	550,000.000	232,876.970	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,240,000.000	2,109,296.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,500,000.000	1,460,188.500	
	SPAIN 1.85 07/30/35	1,400,000.000	1,136,325.400	
	SPAIN 1.9 10/31/52	1,700,000.000	1,016,135.900	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,640,000.000	1,587,643.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,331,352.100	
	SPAIN 2.15 10/31/25	3,550,000.000	3,472,982.750	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,960,000.000	1,744,400.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,400,000.000	1,284,570.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,100,000.000	832,104.090	
	SPAIN 2.8 05/31/26	2,600,000.000	2,564,380.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,750,000.000	1,399,422.500	
	SPAIN 3.15 04/30/33	2,400,000.000	2,295,009.250	
	SPAIN 3.45 07/30/43	400,000.000	356,336.820	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,340,000.000	1,086,747.060	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,000,000.000	1,005,261.000	
	SPAIN 3.55 10/31/33	2,100,000.000	2,063,460.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	500,000.000	485,102.130	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,980,000.000	2,024,965.800	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,900,000.000	1,938,127.300	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,900,000.000	2,022,884.400	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,330,000.000	1,442,385.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,100,000.000	1,191,465.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	900,000.000	1,011,185.370	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	2,782,832.400	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,800,000.000	2,982,338.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,500,000.000	1,688,635.500	
	ユーロ 小計	569,600,000.000 (92,315,072,000)	515,847,461.180 (83,603,398,033)	
国債証券	合計	287,711,995,874.600 (287,711,995,875)	255,838,379,012 (255,838,379,012)	
合計			255,838,379,012 (255,838,379,012)	

(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 250銘柄	47.98	48.22
イギリス・ポンド	国債証券 56銘柄	4.96	4.99
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.30	0.30
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.42	1.43
オフショア・人民元	国債証券 41銘柄	7.12	7.16
カナダ・ドル	国債証券 40銘柄	1.96	1.97
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	0.43	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.20	0.20
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.31	0.31
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	0.23	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.17	0.17
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.50	0.51
マレーシア・リングgit	国債証券 28銘柄	0.51	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券 17銘柄	0.90	0.90
ユーロ	国債証券 359銘柄	32.52	32.68

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,590,896,471
コール・ローン	611,128,815
株式	1,145,801,688,216
投資信託受益証券	1,801,607,897
投資証券	20,843,818,365
派生商品評価勘定	395,085,744
未収入金	7,784,118
未収配当金	964,578,472
差入委託証拠金	7,736,239,267
流動資産合計	1,183,752,827,365
資産合計	1,183,752,827,365
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,978,469
未払金	98,401,483
未払解約金	150,590,000
流動負債合計	263,969,952
負債合計	263,969,952
純資産の部	
元本等	
元本	158,641,305,618
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,024,847,551,795
元本等合計	1,183,488,857,413
純資産合計	1,183,488,857,413
負債純資産合計	1,183,752,827,365

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11月12日 至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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11月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	129,749,605,564円
同期中追加設定元本額	77,958,182,886円
同期中一部解約元本額	49,066,482,832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	3,846,791,658円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	1,865,878円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	7,563,940円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	20,049,315円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	26,037,325円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	23,163,510円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	16,877,852円
たわらノーロード 先進国株式	53,919,418,823円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	287,629,129円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,866,204,770円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	909,648,205円
たわらノーロード バランス (堅実型)	86,800,206円
たわらノーロード バランス (標準型)	782,131,507円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,017,426,794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)	35,535,208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)	234,223,165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)	244,407,582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)	415,049,349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)	298,902円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	14,702,414円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,787,997円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,064,378円
たわらノーロード 全世界株式	1,220,380,707円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	56,414,918,170円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3,172,519,147円
O n e グローバルバランス	19,155,846円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	141,675,638円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	782,692,927円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,030,919,793円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	85,303,134円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	238,308,026円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	243,460,338円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,709,590円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	665,830,785円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	120,769,833円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	162,604,554円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	186,602,354円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	313,264,885円
投資のソムリエ	10,034,767,621円
クルーズコントロール	80,010,803円
投資のソムリエ<DC年金>	912,156,533円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	186,201,595円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	282,741,350円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	995,798,943円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,471,962,269円
ワールドアセットバランス (基本コース)	111,623,980円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	179,027,460円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	55,188,050円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	27,617,304円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	8,065,663円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	167,669,251円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	139,485,397円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	654,569,192円
９資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	134,509,121円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	57,228,517円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	30,143,568円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	18,279,302円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	133,843,713円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,397,624円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	34,969,360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）	1,879,558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）	1,898,510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）	1,165,991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）	1,906,249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）	4,860,733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）	1,743,578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）	330,443,883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）	35,393,692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）	1,106,969,473円
DIAM先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,708,557円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,268,187,075円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	297,796,144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）	768,989円
DIAMワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	5,884,820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）	3,214,782円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	4,656,604円
DIAMグローバル・バランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	21,757,872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）	39,215,007円
DIAM国際分散バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,553,378円
DIAM国際分散バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	10,286,984円
DIAM国内重視バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,016,050円
DIAM国内重視バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	31,268円
DIAM世界バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	912,215円
DIAM世界バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	16,254,337円
DIAMバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	118,759,292円
DIAMバランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	212,785,591円
DIAMバランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	733,276,650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）	30,983,929円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA２（適格機関投資家限	26,423,563円

定)	
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)	185,550,431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)	5,891,063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)	141,051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)	69,768,779円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	5,577,238円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	23,007,475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)	40,468,225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)	83,347,719円
動的パッケージファンド<DC年金>	14,184,867円
コア資産形成ファンド	8,328,147円
たわらノーロード 先進国株式 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	2,673,314,578円
MHAM外国株式インデックスファンド	136,278,183円
たわらノーロード 先進国株式 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	11,310,282円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,672,117,081円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,927,232,693円
計	158,641,305,618円
2. 受益権の総数	158,641,305,618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11月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

<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11月13日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		38,473,934,166
投資信託受益証券		△56,805,667
投資証券		△2,684,254,053
合計		35,732,874,446

(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(2023年2月16日から2023年11月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年11月13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	81,374,273	—	81,373,532	741
イギリス・ポンド	54,689,755	—	54,691,230	△1,475
オーストラリア・ドル	26,684,518	—	26,682,302	2,216
買建	532,452,011	—	533,211,403	759,392
アメリカ・ドル	393,824,960	—	394,358,136	533,176
イギリス・ポンド	12,761,964	—	12,794,118	32,154
オーストラリア・ドル	7,502,430	—	7,514,364	11,934
カナダ・ドル	25,359,035	—	25,371,240	12,205
ユーロ	93,003,622	—	93,173,545	169,923
合計	613,826,284	—	614,584,935	760,133

(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11月13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	14,638,819,584	—	15,018,166,726	379,347,142
合計	14,638,819,584	—	15,018,166,726	379,347,142

(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11月13日現在	
1口当たり純資産額	7.4602円
(1万口当たり純資産額)	(74,602円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年11月13日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,369,189	143.560	196,560,772.840	
	ABBOTT LABORATORIES	257,696	93.970	24,215,693.120	
	AES CORP	90,680	15.700	1,423,676.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	134,350	149.020	20,020,837.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	239,309	118.590	28,379,654.310	
	ADOBE INC	67,635	597.220	40,392,974.700	
	CHUBB LTD	61,414	222.440	13,660,930.160	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	32,968	265.460	8,751,685.280	

INC				
ALLSTATE CORP	37,592	130.320	4,898,989.440	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	98,492	186.710	18,389,441.320	
AMGEN INC	79,330	267.310	21,205,702.300	
HESS CORP	41,496	141.590	5,875,418.640	
AMERICAN EXPRESS CO	93,688	154.380	14,463,553.440	
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,342	77.700	6,009,473.400	
AFLAC INC	84,730	81.480	6,903,800.400	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	63.820	6,902,133.000	
ANALOG DEVICES	74,327	172.320	12,808,028.640	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	102,432	51.250	5,249,640.000	
VALERO ENERGY CORP	54,042	122.670	6,629,332.140	
ANSYS INC	13,252	291.500	3,862,958.000	
APPLE INC	2,331,541	186.400	434,599,242.400	
APPLIED MATERIALS INC	124,811	150.680	18,806,521.480	
ALBEMARLE CORP	16,936	116.980	1,981,173.280	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	72.500	5,909,040.000	
AMEREN CORP	40,644	76.270	3,099,917.880	
ARROW ELECTRONICS INC	7,306	120.540	880,665.240	
AUTODESK INC	32,074	210.580	6,754,142.920	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	61,235	228.490	13,991,585.150	
AUTOZONE INC	2,716	2,702.340	7,339,555.440	
AVERY DENNISON CORP	11,542	180.090	2,078,598.780	
BALL CORP	46,288	48.810	2,259,317.280	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	191,620	350.560	67,174,307.200	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	116,387	45.660	5,314,230.420	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	32.820	2,341,280.340	
BECTON DICKINSON & CO	42,082	234.650	9,874,541.300	
AMETEK INC	34,476	150.800	5,198,980.800	
VERIZON COMM INC	624,821	35.710	22,312,357.910	
WR BERKLEY CORP	31,607	68.150	2,154,017.050	
BEST BUY CO INC	30,568	64.120	1,960,020.160	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	304.040	918,504.840	
YUM! BRANDS INC	42,053	125.950	5,296,575.350	
FIRSTENERGY CORP	83,697	35.300	2,954,504.100	
BOEING CO	84,887	196.650	16,693,028.550	
ROBERT HALF INC	14,456	76.990	1,112,967.440	
BORGWARNER INC	37,010	32.370	1,198,013.700	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	213,388	51.560	11,002,285.280	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	79.960	1,377,950.680	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	24,197	147.880	3,578,252.360	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,044.110	3,561,459.210
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	312,164	50.610	15,798,620.040
ONEOK INC	82,535	64.360	5,311,952.600
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	108.450	1,052,941.050
UNITED RENTALS INC	9,765	456.530	4,458,015.450
SEMPRA	93,163	70.340	6,553,085.420
FEDEX CORP	35,569	246.030	8,751,041.070
VERISIGN INC	13,302	207.260	2,756,972.520
AMPHENOL CORP	88,014	86.610	7,622,892.540
BROWN-FORMAN CORP	48,308	57.020	2,754,522.160
QUANTA SERVICES INC	20,709	174.070	3,604,815.630
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.630	471,171.950
CSX CORP	304,211	30.700	9,339,277.700
COTERRA ENERGY INC	114,711	26.970	3,093,755.670
CAMPBELL SOUP CO	26,978	40.420	1,090,450.760
CONSTELLATION BRANDS INC	24,629	239.320	5,894,212.280
CARDINAL HEALTH INC	38,298	104.120	3,987,587.760
CARLISLE COS INC	7,520	268.520	2,019,270.400
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	12.760	1,893,686.080
CATERPILLAR INC	76,504	239.680	18,336,478.720
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	142.050	1,794,233.550
JPMORGAN CHASE & CO	432,533	146.430	63,335,807.190
CHURCH & DWIGHT CO INC	35,778	89.720	3,210,002.160
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,876	99.730	2,281,423.480
CINTAS CORP	13,507	533.480	7,205,714.360
CISCO SYSTEMS INC	602,573	52.590	31,689,314.070
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	16.550	1,148,090.050
CLOROX COMPANY	18,305	133.460	2,442,985.300
COCA-COLA CO/THE	607,988	56.720	34,485,079.360
COPART INC	128,373	48.730	6,255,616.290
COGNEX CORP	25,772	36.380	937,585.360
COLGATE-PALMOLIVE CO	117,230	75.430	8,842,658.900
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	38,376	197.600	7,583,097.600
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	358.080	3,196,938.240
NRG ENERGY, INC.	34,874	45.550	1,588,510.700
COMCAST CORP-CL A	616,451	41.910	25,835,461.410
CONAGRA BRANDS INC	73,639	27.810	2,047,900.590
CONSOLIDATED EDISON INC	51,736	89.350	4,622,611.600
CMS ENERGY CORP	44,128	55.600	2,453,516.800
COOPER COS INC	7,240	329.280	2,383,987.200
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	58.970	1,490,820.570
CORNING INC	116,325	27.680	3,219,876.000
WOLFSPEED INC	15,684	32.380	507,847.920
SEALED AIR CORP	17,610	32.340	569,507.400

HEICO CORP-CL A	9,463	133.020	1,258,768.260	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	214.360	2,023,987.120	
CUMMINS INC	21,250	219.020	4,654,175.000	
DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	42.020	1,000,328.120	
DR HORTON INC	45,784	122.700	5,617,696.800	
DANAHER CORP	103,928	197.000	20,473,816.000	
MOODY'S CORP	24,521	344.570	8,449,200.970	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	65.950	5,012,002.150	
TARGET CORP	69,096	108.330	7,485,169.680	
DEERE & CO	41,361	373.990	15,468,600.390	
MORGAN STANLEY	185,673	75.330	13,986,747.090	
REPUBLIC SERVICES INC	31,486	157.790	4,968,175.940	
COSTAR GROUP INC	58,012	79.650	4,620,655.800	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	632.740	2,358,221.980	
THE WALT DISNEY CO	271,326	88.270	23,949,946.020	
DOLLAR TREE INC	31,756	114.080	3,622,724.480	
DOVER CORP	20,350	131.630	2,678,670.500	
OMNICOM GROUP	30,586	75.740	2,316,583.640	
DTE ENERGY CO	30,044	98.570	2,961,437.080	
DUKE ENERGY CORP	113,639	88.270	10,030,914.530	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,701	150.100	2,656,920.100	
EBAY INC	75,181	39.850	2,995,962.850	
BANK OF AMERICA CORP	1,063,728	27.680	29,443,991.040	
CITIGROUP INC	288,199	42.080	12,127,413.920	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	77.130	1,295,012.700	
EATON CORP PLC	59,302	221.820	13,154,369.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	40,689	261.560	10,642,614.840	
ECOLAB INC	38,151	177.900	6,787,062.900	
REVVITY INC	17,972	84.490	1,518,454.280	
ELECTRONIC ARTS INC	36,801	132.780	4,886,436.780	
SALESFORCE INC	144,718	213.630	30,916,106.340	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	278.360	938,629.920	
EMERSON ELECTRIC CO	84,776	86.500	7,333,124.000	
ATMOS ENERGY CORP	21,199	111.410	2,361,780.590	
ENTERGY CORP	30,736	96.610	2,969,404.960	
EOG RESOURCES INC	86,645	122.700	10,631,341.500	
EQUIFAX INC	18,730	184.910	3,463,364.300	
EQT CORP	51,269	39.130	2,006,155.970	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	114.750	4,113,328.500	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	115.350	2,585,570.250	
EXXON MOBIL CORP	593,892	103.750	61,616,295.000	
FMC CORP	17,711	51.240	907,511.640	
NEXTERA ENERGY INC	300,997	55.140	16,596,974.580	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	453.020	2,451,744.240	
FAIR ISAAC CORP	3,775	996.700	3,762,542.500	
ASSURANT INC	8,766	163.060	1,429,383.960	
FASTENAL CO	85,603	60.010	5,137,036.030	

FIFTH THIRD BANCORP	105,410	25.060	2,641,574.600
M&T BANK CORP	24,958	118.350	2,953,779.300
FIRST HORIZON CORP	69,634	11.290	786,167.860
FISERV INC	91,718	121.510	11,144,654.180
FORD MOTOR CO	585,908	9.860	5,777,052.880
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	22.920	1,088,172.840
FREEMPORT-MCMORAN INC	214,628	33.680	7,228,671.040
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,405.470	2,226,264.480
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,707	248.270	7,871,896.890
DENTSPLY SIRONA INC	34,681	28.390	984,593.590
GENERAL DYNAMICS CORP	34,634	243.550	8,435,110.700
GENERAL MILLS INC	88,517	65.280	5,778,389.760
GENUINE PARTS CO	20,769	136.160	2,827,907.040
GILEAD SCIENCES INC	185,219	75.920	14,061,826.480
GARTNER INC	11,246	411.630	4,629,190.980
MCKESSON CORP	20,139	469.290	9,451,031.310
NVIDIA CORP	366,286	483.350	177,044,338.100
GRACO INC	23,985	77.870	1,867,711.950
GENERAL ELECTRIC CO	161,665	115.270	18,635,124.550
WW GRAINGER INC	6,777	792.250	5,369,078.250
HALLIBURTON CO	129,305	38.290	4,951,088.450
MONSTER BEVERAGE CORP	117,637	55.280	6,502,973.360
GOLDMAN SACHS GROUP INC	49,219	325.510	16,021,276.690
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,728	182.170	5,233,379.760
HASBRO INC	16,359	43.110	705,236.490
HENRY SCHEIN INC	17,431	64.070	1,116,804.170
HEICO CORP	6,878	165.330	1,137,139.740
HERSHEY FOODS CORP	22,500	191.480	4,308,300.000
HP INC	124,613	27.620	3,441,811.060
F5 INC	8,981	159.050	1,428,428.050
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	80.420	1,457,612.500
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	222.840	1,386,510.480
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	27.140	1,186,425.100
HOLOGIC INC	38,399	72.130	2,769,719.870
HOME DEPOT INC	148,947	291.590	43,431,455.730
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	83.980	2,210,269.620
HORMEL FOODS CORP	49,054	32.500	1,594,255.000
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	27.120	2,651,685.120
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	396.610	1,950,131.370
HUBBELL INC	7,820	289.520	2,264,046.400
HUMANA INC	18,641	493.110	9,192,063.510
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	173.820	2,133,814.320
HUNTINGTON BANCSHARES INC	215,385	10.270	2,212,003.950
BIOGEN INC	21,910	224.790	4,925,148.900
IDEX CORP	11,045	191.720	2,117,547.400

ILLINOIS TOOL WORKS	44,869	232.490	10,431,593.810	
INTUIT INC	41,569	528.890	21,985,428.410	
IDEXX LABORATORIES INC	12,500	428.730	5,359,125.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	33,856	225.480	7,633,850.880	
INTEL CORP	619,142	38.860	24,059,858.120	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	35,897	71.740	2,575,250.780	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	33.090	1,461,022.770	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	28.980	1,566,745.740	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	147.990	1,754,717.430	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	128.260	2,512,100.360	
INCYTE CORP	31,654	52.440	1,659,935.760	
JOHNSON & JOHNSON	356,591	147.250	52,508,024.750	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	73.970	3,377,396.230	
KLA CORPORATION	20,432	534.250	10,915,796.000	
DEVON ENERGY CORP	96,985	45.620	4,424,455.700	
KELLANOVA	42,451	51.820	2,199,810.820	
KEYCORP	144,072	10.950	1,577,588.400	
KIMBERLY-CLARK CORP	50,460	120.840	6,097,586.400	
BLACKROCK INC/NEW YORK	22,139	665.000	14,722,435.000	
KROGER CO	97,173	43.890	4,264,922.970	
LAM RESEARCH CORP	20,026	685.430	13,726,421.180	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	382.800	2,511,550.800	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	155.630	2,093,379.130	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	56.950	1,153,807.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	110.770	2,582,381.010	
LENNAR CORP	37,667	122.200	4,602,907.400	
ELI LILLY & CO	119,666	597.710	71,525,564.860	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	31.040	873,962.240	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	107,486	138.110	14,844,891.460	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,825	108.470	4,862,167.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	33,842	444.870	15,055,290.540	
LOEWS CORP	30,289	65.890	1,995,742.210	
LOWE'S COS INC	86,951	194.600	16,920,664.600	
DOMINION ENERGY INC	126,501	44.960	5,687,484.960	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	38.740	1,565,134.740	
MCCORMICK & CO INC	35,510	64.930	2,305,664.300	
MCDONALD'S CORPORATION	108,041	267.790	28,932,299.390	
S&P GLOBAL INC	48,610	393.970	19,150,881.700	
EVEREST GROUP LTD	6,670	384.680	2,565,815.600	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,339.720	2,696,856.360	
EDWARDS LIFESCIENCES	91,510	64.210	5,875,857.100	

CORP NPR				
MARSH & MCLENNAN COS	72,722	200.450	14,577,124.900	
MASCO CORP	34,561	56.170	1,941,291.370	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,365	453.870	4,250,492.550	
METLIFE INC	97,405	60.490	5,892,028.450	
MEDTRONIC PLC	197,294	70.680	13,944,739.920	
CVS HEALTH CORP	190,547	67.680	12,896,220.960	
MERCK & CO. INC.	375,951	101.390	38,117,671.890	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	67.380	4,396,545.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,876	204.780	2,636,747.280	
MICROSOFT CORP	1,047,225	369.670	387,127,665.750	
MICRON TECH INC	163,017	75.360	12,284,961.120	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	81,668	77.560	6,334,170.080	
3M CO	82,577	92.810	7,663,971.370	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	80.660	509,045.260	
ENTEGRIS INC	20,987	95.520	2,004,678.240	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	171.990	1,319,851.260	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,847	311.020	7,727,913.940	
ILLUMINA INC	24,379	98.370	2,398,162.230	
XCEL ENERGY INC	82,777	59.200	4,900,398.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	107.170	1,566,075.210	
NETAPP INC	32,785	77.140	2,529,034.900	
NEWMONT CORP	163,728	34.200	5,599,497.600	
NVR INC	483	6,035.290	2,915,045.070	
NIKE INC-CL B	182,817	106.110	19,398,711.870	
NORDSON CORP	7,548	225.110	1,699,130.280	
NORFOLK SOUTHERN CORP	34,140	196.880	6,721,483.200	
EVERSOURCE ENERGY	51,861	53.800	2,790,121.800	
NISOURCE INC	64,543	25.000	1,613,575.000	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	70.700	2,323,767.600	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,526	463.270	9,972,350.020	
WELLS FARGO & CO	543,255	40.890	22,213,696.950	
NUCOR CORP	37,496	152.620	5,722,639.520	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	171.620	6,250,743.640	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54,649	104.580	5,715,192.420	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,774	60.980	6,084,218.520	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,060	392.630	5,520,377.800	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	986.220	8,958,822.480	
ORACLE CORP	241,712	113.070	27,330,375.840	
PACCAR INC	77,744	88.260	6,861,685.440	
PTC INC	15,968	151.610	2,420,908.480	
EXELON CORP	147,025	39.430	5,797,195.750	

PARKER HANNIFIN CORP	19,211	419.450	8,058,053.950	
PAYCHEX INC	45,745	115.430	5,280,345.350	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,491	192.130	2,015,635.830	
PPL CORPORATION	113,687	25.340	2,880,828.580	
PEPSICO INC	203,773	166.920	34,013,789.160	
PENTAIR PLC	25,545	61.400	1,568,463.000	
PFIZER INC	838,053	29.480	24,705,802.440	
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	33.670	1,357,540.730	
CONOCOPHILLIPS	179,242	115.610	20,722,167.620	
PG&E CORP	283,772	16.780	4,761,694.160	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34,773	233.560	8,121,581.880	
ALTRIA GROUP INC	263,679	40.020	10,552,433.580	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	59,805	120.430	7,202,316.150	
BROWN & BROWN INC	36,907	72.850	2,688,674.950	
GARMIN LTD	23,281	116.620	2,715,030.220	
PPG INDUSTRIES INC	33,627	128.810	4,331,493.870	
COSTCO WHOLESALE CORP	65,588	577.120	37,852,146.560	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	92.620	3,176,217.660	
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	132.820	2,201,358.680	
PROCTER & GAMBLE CO	348,735	151.410	52,801,966.350	
PROGRESSIVE CORP	87,083	160.390	13,967,242.370	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,243	61.610	4,574,111.230	
PULTE GROUP INC	33,950	82.370	2,796,461.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,240	109.180	4,065,863.200	
QUALCOMM INC	165,351	124.210	20,538,247.710	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,141	100.500	2,928,670.500	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	59.760	1,556,449.200	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	8,747	267.210	2,337,285.870	
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,052	798.940	12,824,584.880	
REPLIGEN CORP	6,730	147.560	993,078.800	
RESMED INC	22,899	143.600	3,288,296.400	
US BANCORP	229,227	34.200	7,839,563.400	
SEAGEN INC	19,998	213.720	4,273,972.560	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,309	85.950	4,839,758.550	
ROSS STORES INC	50,878	123.330	6,274,783.740	
ROLLINS INC	45,708	38.400	1,755,187.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	15,771	517.150	8,155,972.650	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,327	258.430	4,477,816.610	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	34,772	94.910	3,300,210.520	
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	97.750	1,882,469.500	
ACCENTURE PLC-CL A	93,496	319.690	29,889,736.240	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	202,099	69.120	13,969,082.880	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	240.210	3,895,485.570	
AXON ENTERPRISE INC	9,471	217.940	2,064,109.740	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	34,835	169.960	5,920,556.600	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	89,354	52.410	4,683,043.140	
BOOKING HOLDINGS INC	5,486	3,074.230	16,865,225.780	
SCHLUMBERGER LTD	212,211	53.300	11,310,846.300	
SCHWAB (CHARLES) CORP	224,033	54.410	12,189,635.530	
POOL CORP	5,406	330.540	1,786,899.240	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	105.420	3,385,457.880	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	56.550	818,674.350	
ELEVANCE HEALTH INC	35,171	458.250	16,117,110.750	
CENCORA INC	25,701	197.570	5,077,746.570	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	69.570	2,476,065.870	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	36,435	255.750	9,318,251.250	
CENTENE CORP	82,487	71.870	5,928,340.690	
SMITH (A. O.) CORP	19,563	72.820	1,424,577.660	
SNAP-ON INC	8,204	270.040	2,215,408.160	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,392	92.030	5,005,695.760	
EDISON INTERNATIONAL	57,612	63.720	3,671,036.640	
SOUTHERN CO	160,721	68.100	10,945,100.100	
TRUIST FINANCIAL CORP	198,729	29.390	5,840,645.310	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	23.160	456,252.000	
AT&T INC	1,063,626	15.640	16,635,110.640	
CHEVRON CORP	269,029	142.950	38,457,695.550	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	85.070	1,921,901.440	
STATE STREET CORP	50,416	67.600	3,408,121.600	
STARBUCKS CORP	170,073	104.330	17,743,716.090	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	109.020	2,500,591.740	
STRYKER CORP	50,652	273.620	13,859,400.240	
NETFLIX INC	66,002	447.240	29,518,734.480	
GEN DIGITAL INC	92,583	19.280	1,785,000.240	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	49.870	1,366,438.000	
SYNOPSYS INC	22,666	518.830	11,759,800.780	
SYSCO CORP	76,419	67.340	5,146,055.460	
INTUITIVE SURGICAL INC	52,093	277.490	14,455,286.570	
TELEFLEX INC	6,985	200.050	1,397,349.250	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	8.680	1,469,090.000	
TERADYNE INC	22,066	88.120	1,944,455.920	
TEXAS INSTRUMENTS INC	134,433	147.190	19,787,193.270	
TEXTRON INC	30,883	76.120	2,350,813.960	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	57,220	448.430	25,659,164.600	

GLOBE LIFE INC	12,153	116.640	1,417,525.920
TORO CO	14,644	83.820	1,227,460.080
DAVITA INC	6,813	82.990	565,410.870
TRACTOR SUPPLY CO	16,808	198.540	3,337,060.320
BIO-TECHNE CORP	25,934	57.490	1,490,945.660
TRIMBLE INC	37,504	41.850	1,569,542.400
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,175	418.700	2,585,472.500
TYSON FOODS INC	41,316	46.950	1,939,786.200
MARATHON OIL CORP	92,952	25.090	2,332,165.680
UNION PACIFIC CORP	90,300	211.490	19,097,547.000
RTX CORP	217,454	82.220	17,879,067.880
UNITEDHEALTH GROUP INC	137,987	541.210	74,679,944.270
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	130.230	1,054,342.080
VF CORP	51,762	14.900	771,253.800
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	12.100	984,044.600
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	38,348	373.650	14,328,730.200
VULCAN MATERIALS CO	20,095	211.660	4,253,307.700
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	20.760	2,223,894.240
WALMART INC	219,021	166.190	36,399,099.990
WASTE MANAGEMENT INC	60,476	171.770	10,387,962.520
WATERS CORP	8,786	255.920	2,248,513.120
WATSCO INC	4,889	376.430	1,840,366.270
WEBSTER FINANCIAL CORP	28,834	39.350	1,134,617.900
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,626	341.650	3,630,372.900
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	108.740	1,696,778.960
VAIL RESORTS INC	6,523	221.150	1,442,561.450
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	45.000	2,225,295.000
WABTEC CORP	25,714	112.530	2,893,596.420
WHIRLPOOL CORP	9,534	109.790	1,046,737.860
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	90.030	2,001,817.050
WYNN RESORTS LTD	15,379	85.490	1,314,750.710
NASDAQ INC	47,600	52.110	2,480,436.000
CME GROUP INC	53,291	217.110	11,570,009.010
WILLIAMS COS INC	180,781	34.880	6,305,641.280
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	112.580	962,671.580
LKQ CORP	37,072	44.830	1,661,937.760
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	48.570	1,968,250.680
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	80.310	3,845,403.420
CARMAX INC	22,414	63.370	1,420,375.180
TJX COMPANIES INC	169,870	91.200	15,492,144.000
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	206.180	1,605,111.300
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.230	504,038.270
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	39.970	940,414.160

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	161.890	3,119,782.190	
CBRE GROUP INC	44,502	73.490	3,270,451.980	
REGIONS FINANCIAL CORP	133,681	15.120	2,021,256.720	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	378.510	1,944,405.870	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,469	504.580	3,264,128.020	
WESTLAKE CORP	6,030	121.980	735,539.400	
T-MOBILE US INC	80,697	147.610	11,911,684.170	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	47.750	2,283,405.000	
MOSAIC CO/THE	48,502	33.640	1,631,607.280	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	222.940	1,085,940.740	
CELANESE CORP	16,273	118.510	1,928,513.230	
DEXCOM INC	58,553	94.050	5,506,909.650	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	124.320	2,430,953.280	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	118.680	2,608,349.040	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	79.530	2,462,964.570	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	336.360	5,225,688.960	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	36,034	17.000	612,578.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	84,672	109.780	9,295,292.160	
LIVE NATION	23,597	87.520	2,065,209.440	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,117	2,120.580	8,730,427.860	
TRANSDIGM GROUP INC	8,166	992.500	8,104,755.000	
MASTERCARD INC	125,305	394.380	49,417,785.900	
OWENS CORNING	13,227	124.300	1,644,116.100	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	103.550	1,870,216.550	
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	66.860	1,629,979.940	
FIRST SOLAR INC	15,579	133.920	2,086,339.680	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,070	177.120	3,023,438.400	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,263	266.030	1,932,175.890	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	80.310	1,694,059.140	
DELTA AIR LINES INC	21,592	34.060	735,423.520	
INSULET CORP	10,158	155.100	1,575,505.800	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	83.510	3,272,589.880	
TE CONNECTIVITY LTD	47,054	126.650	5,959,389.100	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,255	413.670	7,137,875.850	
VMWARE INC	35,499	149.660	5,312,780.340	
MERCADOLIBRE INC	6,748	1,374.390	9,274,383.720	
ULTA BEAUTY INC	7,263	389.710	2,830,463.730	
INVESCO LTD	57,267	13.080	749,052.360	
MSCI INC	11,948	514.260	6,144,378.480	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	229,491	89.700	20,585,342.700	
VISA INC	239,625	245.250	58,768,031.250	
KEURIG DR PEPPER INC	131,027	30.970	4,057,906.190	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	27,995	123.500	3,457,382.500	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,096	145.130	9,157,122.480	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	61.000	1,307,230.000	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	298,312	16.440	4,904,249.280	
XYLEM INC	33,760	98.460	3,324,009.600	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,272	93.820	3,496,859.040	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	229.930	1,490,176.330	
SPLUNK INC	22,702	147.000	3,337,194.000	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	235.360	1,921,008.320	
HCA HEALTHCARE INC	30,702	232.820	7,148,039.640	
VERISK ANALYTICS INC	21,663	237.930	5,154,277.590	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,706	120.200	1,286,861.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,295	231.210	2,380,306.950	
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,938	186.670	7,268,556.460	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,242	126.000	2,424,492.000	
TARGA RESOURCES CORP	33,263	84.560	2,812,719.280	
LEAR CORP	9,398	127.460	1,197,869.080	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,608	174.970	2,730,931.760	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	52.790	1,810,433.050	
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	117.940	3,944,385.360	
FORTINET INC	100,599	50.820	5,112,441.180	
HYATT HOTELS CORP	6,647	107.990	717,809.530	
TESLA INC	423,117	214.650	90,822,064.050	
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	103.550	943,444.050	
ENPHASE ENERGY INC	18,600	77.980	1,450,428.000	
GENERAL MOTORS CO	208,056	26.850	5,586,303.600	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	25.530	1,001,541.900	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	228.570	2,718,840.150	
APTIV PLC	43,097	75.930	3,272,355.210	
PHILLIPS 66	68,358	113.440	7,754,531.520	
META PLATFORMS INC	328,040	328.770	107,849,710.800	
IQVIA HOLDINGS INC	27,848	195.980	5,457,651.040	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,850	157.710	3,919,093.500	
SERVICENOW INC	30,328	634.760	19,251,001.280	
PALO ALTO NETWORKS INC	45,643	253.510	11,570,956.930	
WORKDAY INC	31,060	230.010	7,144,110.600	
ABBVIE INC	261,732	138.590	36,273,437.880	
ZOETIS INC	68,687	169.320	11,630,082.840	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	20.920	1,134,094.120	
CDW CORP	20,262	211.670	4,288,857.540	
HOWMET AEROSPACE INC	55,049	49.550	2,727,677.950	

TWILIO INC	25,710	58.840	1,512,776.400
SNAP INC	152,250	11.320	1,723,470.000
TRADE DESK INC A	66,855	64.010	4,279,388.550
OKTA INC	21,831	67.770	1,479,486.870
BAKER HUGHES CO	152,160	34.340	5,225,174.400
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	94.070	2,049,314.950
BROADCOM INC	61,179	957.520	58,580,116.080
ARES MANAGEMENT CORP	23,161	107.750	2,495,597.750
MONGODB INC	10,075	376.890	3,797,166.750
BURLINGTON STORES INC	10,565	130.710	1,380,951.150
VEEVA SYSTEMS INC	20,705	165.080	3,417,981.400
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	31.550	786,793.900
EVERGY INC	33,192	49.410	1,640,016.720
ALLEGION PLC	13,423	103.490	1,389,146.270
CERIDIAN HCM HOLDING INC	22,002	65.450	1,440,030.900
STERIS PLC	14,158	199.320	2,821,972.560
DOCUSIGN INC	26,362	40.980	1,080,314.760
WIX.COM LTD	8,997	89.290	803,342.130
DROPBOX INC	41,801	26.610	1,112,324.610
KKR & CO INC	90,373	63.550	5,743,204.150
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	57.960	292,698.000
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	62.060	2,101,165.420
MODERNA INC	46,344	70.050	3,246,397.200
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	37,708	161.800	6,101,154.400
ARAMARK	31,641	28.520	902,401.320
CIGNA GROUP	43,912	293.210	12,875,437.520
DELL TECHNOLOGIES INC	38,669	73.500	2,842,171.500
DOW INC	100,232	49.480	4,959,479.360
OVINTIV INC	39,160	44.590	1,746,144.400
AMCOR PLC	223,348	9.070	2,025,766.360
PINTEREST INC	90,936	31.070	2,825,381.520
FOX CORP-A	36,501	30.130	1,099,775.130
FOX CORP-B	27,507	28.080	772,396.560
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	6.570	279,790.020
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	33,813	196.310	6,637,830.030
CHEWY INC	9,648	19.960	192,574.080
AVANTOR INC	97,157	18.560	1,803,233.920
DYNATRACE INC	39,362	50.510	1,988,174.620
CLOUDFLARE INC	39,310	63.080	2,479,674.800
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	93.250	1,577,603.500
CARRIER GLOBAL CORP	124,379	51.500	6,405,518.500
OTIS WORLDWIDE CORP	58,737	82.030	4,818,196.110
UBER TECHNOLOGIES INC	271,114	51.580	13,984,060.120
CORTEVA INC	108,001	43.550	4,703,443.550
MATCH GROUP INC	44,764	29.700	1,329,490.800
FERGUSON PLC	29,134	159.940	4,659,691.960
BILL HOLDINGS INC	11,865	56.480	670,135.200

BLACKSTONE INC	105,031	98.640	10,360,257.840
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,809	149.320	867,399.880
CARLYLE GROUP INC	34,847	30.160	1,050,985.520
DATADOG INC	38,635	103.650	4,004,517.750
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	72.420	1,860,397.380
INGERSOLL RAND INC	57,353	68.340	3,919,504.020
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	58,591	69.520	4,073,246.320
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	171.160	1,530,341.560
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	15.400	1,438,760.400
DRAFTKINGS INC	63,900	35.030	2,238,417.000
UNITY SOFTWARE INC	30,839	27.010	832,961.390
AON PLC	30,296	334.040	10,120,075.840
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	10.130	3,559,894.730
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,641.000	1,486,746.000
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	51.900	1,745,604.600
COINBASE GLOBAL INC	23,696	92.920	2,201,832.320
UIPATH INC	53,439	17.300	924,494.700
AIRBNB INC	61,583	118.150	7,276,031.450
CONSTELLATION ENERGY CORP	45,938	121.770	5,593,870.260
MONDAY.COM LTD	3,043	140.120	426,385.160
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	27.220	1,692,349.060
ROBLOX CORP	59,573	38.420	2,288,794.660
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	12.760	534,695.040
VIATRIS INC	184,148	9.200	1,694,161.600
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	43.300	1,498,353.200
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	79.090	1,253,260.140
HF SINCLAIR CORP	20,299	53.800	1,092,086.200
SNOWFLAKE INC	39,207	160.400	6,288,802.800
DOORDASH INC	36,227	87.470	3,168,775.690
ARISTA NETWORKS INC	39,238	206.840	8,115,987.920
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	59,548	84.960	5,059,198.080
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	35.180	559,115.740
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	273,108	19.670	5,372,034.360
FNF GROUP	38,907	43.940	1,709,573.580
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	133.940	2,507,758.620
MARVELL TECHNOLOGY INC	129,101	54.620	7,051,496.620
APA CORP	49,146	36.920	1,814,470.320
CONFLUENT INC	27,524	17.680	486,624.320
LINDE PLC	72,413	399.840	28,953,613.920
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	8.230	605,448.180
LUCID GROUP INC	143,927	3.800	546,922.600
U-HAUL HOLDING CO	11,981	49.020	587,308.620

ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	166.740	620,439.540	
TOAST INC	45,399	14.110	640,579.890	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.270	914,014.050	
CATALENT INC	27,357	33.550	917,827.350	
SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	29.570	2,031,488.570	
VERALTO CORP	32,610	70.550	2,300,635.500	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	19,871	25.435	505,418.880	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	28,191	67.850	1,912,759.350	
BUNGE GLOBAL SA	21,715	104.530	2,269,868.950	
KENVUE INC	220,472	19.150	4,222,038.800	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	25.170	1,837,737.210	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	183.950	963,346.150	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	124.250	3,443,340.250	
HUBSPOT INC	6,836	428.920	2,932,097.120	
QORVO INC	14,144	91.660	1,296,439.040	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,444	82.730	1,525,872.120	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	7,789	71.140	554,109.460	
GODADDY INC	19,713	87.650	1,727,844.450	
ETSY INC	18,558	63.240	1,173,607.920	
TRANSUNION	31,262	52.710	1,647,820.020	
ALBERTSONS COS INC	40,041	21.180	848,068.380	
BLOCK INC	78,278	51.500	4,031,317.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	68.740	4,690,473.900	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	60.780	1,884,909.360	
WESTROCK CO	34,286	38.230	1,310,753.780	
KRAFT HEINZ CO	129,447	32.890	4,257,511.830	
FORTIVE CORP	50,061	65.830	3,295,515.630	
WASTE CONNECTIONS INC	38,848	130.540	5,071,217.920	
ALPHABET INC-CL A	881,185	132.590	116,836,319.150	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	186,711	15.960	2,979,907.560	
PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	54.770	8,681,428.390	
SEA LTD ADR	50,316	45.480	2,288,371.680	
EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	26.570	1,496,661.530	
ZILLOW GROUP INC-C	22,374	36.700	821,125.800	
ALPHABET INC-CL C	783,554	134.060	105,043,249.240	
ZSCALER INC	12,304	175.040	2,153,692.160	
ATLASSIAN CORP PLC	21,642	176.290	3,815,268.180	
ROKU INC	19,331	81.310	1,571,803.610	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,042	409.810	5,754,552.020	
VISTRA CORP	49,633	34.480	1,711,345.840	
アメリカ・ドル 小計	50,606,811		5,663,017,963.270	

				(859,136,455,206)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	12.990	796,222.050	
	ASHTREAD GROUP	66,851	49.260	3,293,080.260	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	26.350	1,200,189.800	
	BARCLAYS PLC	2,229,023	1.355	3,020,326.160	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.441	551,554.430	
	BT GROUP PLC	904,198	1.215	1,098,600.570	
	BUNZL PLC	46,691	29.210	1,363,844.110	
	CRH PLC	108,593	48.140	5,227,667.020	
	AVIVA PLC	429,205	4.043	1,735,275.810	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	45.080	927,430.840	
	DIAGEO PLC	333,830	28.500	9,514,155.000	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.880	428,220.080	
	DCC PLC	17,471	46.030	804,190.130	
	NATIONAL GRID PLC	547,462	9.844	5,389,215.920	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.260	759,418.760	
	BAE SYSTEMS PLC	457,388	11.035	5,047,276.580	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	314,741	24.770	7,796,134.570	
	HALMA PLC	51,066	19.315	986,339.790	
	NEXT PLC	18,588	73.820	1,372,166.160	
	IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	17.545	2,213,810.550	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	15.400	307,630.400	
	ANGLO AMERICAN PLC	193,117	20.185	3,898,066.640	
	COMPASS GROUP PLC	259,074	20.820	5,393,920.680	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,924,664	5.992	17,524,586.680	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.205	1,888,359.790	
	CENTRICA PLC	793,776	1.521	1,207,333.290	
	UNILEVER PLC	370,589	39.490	14,634,559.610	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.685	967,729.760	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	23.300	1,282,501.900	
	PEARSON PLC	84,159	9.696	816,005.660	
	PERSIMMON PLC	56,989	11.490	654,803.610	
	PRUDENTIAL PLC	393,799	8.824	3,474,882.370	
	RIO TINTO PLC	167,240	52.590	8,795,151.600	
	VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.763	2,733,754.980	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	107,096	54.920	5,881,712.320	
	RELX PLC	280,647	29.550	8,293,118.850	
	RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.465	1,673,682.920	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,221,103	2.320	2,832,958.960	
	NATWEST GROUP PLC	896,355	1.970	1,765,819.350	
	ST JAMES' S PLACE PLC	89,082	6.502	579,211.160	
	SSE PLC	154,856	16.800	2,601,580.800	
BP PLC	2,571,529	4.778	12,286,765.560		
SAGE GROUP PLC (THE)	152,196	9.940	1,512,828.240		

	SMITHS GROUP PLC	51,695	16.330	844,179.350	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	85.360	917,705.360	
	STANDARD CHARTERED PLC	362,528	6.218	2,254,199.100	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,179,291	0.417	3,827,764.340	
	TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.171	667,309.570	
	TESCO PLC	1,030,735	2.777	2,862,351.090	
	3I GROUP PLC	139,893	20.260	2,834,232.180	
	SMITH & NEPHEW PLC	125,930	9.890	1,245,447.700	
	GSK PLC	607,325	13.984	8,492,832.800	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63,356	85.540	5,419,472.240	
	WPP PLC	142,785	7.012	1,001,208.420	
	ASTRAZENECA PLC	229,936	100.900	23,200,542.400	
	WHITBREAD PLC	31,475	32.640	1,027,344.000	
	INTERTEK GROUP PLC	23,309	38.070	887,373.630	
	BURBERRY GROUP PLC	52,229	16.775	876,141.470	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	58.580	1,574,278.920	
	SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.670	709,704.690	
	ADMIRAL GROUP PLC	32,350	25.500	824,925.000	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	42.420	699,463.380	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	17.525	323,423.870	
	ABRDN PLC	285,831	1.657	473,621.960	
	EXPERIAN PLC	140,133	26.830	3,759,768.390	
	MONDI PLC	74,310	13.825	1,027,335.750	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.134	263,544.220	
	OCADO GROUP PLC	69,766	5.146	359,015.830	
	INFORMA PLC	223,961	7.118	1,594,154.390	
	GLENCORE PLC	1,570,188	4.271	6,706,272.940	
	ENTAIN PLC	96,924	9.256	897,128.540	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	20.850	647,079.750	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	4.642	630,513.570	
	M&G PLC	270,401	2.036	550,536.430	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	16.510	463,518.250	
	WISE PLC	96,207	6.726	647,088.280	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.339	511,593.060	
	HALEON PLC	836,729	3.249	2,718,532.520	
	SHELL PLC	993,556	26.295	26,125,555.020	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	6.820	976,542.160	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.150	1,113,038.600	
	イギリス・ポンド 小計	40,657,641		264,486,822.890 (49,049,081,305)	
イスラエル・ シケル	BANK HAPOLIM BM	187,404	29.550	5,537,788.200	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	27.060	6,469,585.980	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	730.000	2,430,900.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.430	3,003,057.920	

	ICL GROUP LTD	103,067	18.720	1,929,414.240	
	NICE LTD	9,053	649.400	5,879,018.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	131.400	3,868,941.600	
	AZRIELI GROUP	4,672	188.000	878,336.000	
イスラエル・シユケル 小計		738,997		29,997,042.140 (1,177,728,870)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	53.930	1,526,542.580	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	520,190	20.860	10,851,163.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	253,090	23.750	6,010,887.500	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.940	2,363,420.820	
	ASX LTD	31,215	57.460	1,793,613.900	
	BHP GROUP LTD	747,868	45.270	33,855,984.360	
	AMPOL LTD	31,828	33.390	1,062,736.920	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	24.820	2,274,107.680	
	CSL LIMITED	72,171	252.140	18,197,195.940	
	REA GROUP LTD	9,317	156.220	1,455,501.740	
	TRANSURBAN GROUP	476,258	12.580	5,991,325.640	
	COCHLEAR LTD	10,446	252.720	2,639,913.120	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	8.650	2,229,035.800	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	246,769	101.320	25,002,635.080	
	RIO TINTO LIMITED	53,206	120.420	6,407,066.520	
	APA GROUP	164,300	8.240	1,353,832.000	
	ARISTOCRAT LEISU	86,829	40.290	3,498,340.410	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.790	2,084,874.780	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	45.610	2,771,582.870	
	IGO LTD	91,947	8.970	824,764.590	
	ORICA LTD	63,862	15.450	986,667.900	
	LEND LEASE CORP LTD	107,181	6.290	674,168.490	
	BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	19.940	1,527,144.780	
	MACQUARIE GROUP LTD	52,487	162.750	8,542,259.250	
	SUNCORP GROUP LTD	199,628	13.320	2,659,044.960	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	465,095	28.460	13,236,603.700	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.280	594,839.520	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	219,807	15.520	3,411,404.640	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	11.650	1,894,627.850	
	REECE LTD	31,558	18.910	596,761.780	
	SANTOS LTD	478,809	7.220	3,457,000.980	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	30.440	1,975,464.680	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	34.350	1,354,077.000		
WESFARMERS LTD	161,727	53.080	8,584,469.160		

	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	282,153	32.030	9,037,360.590	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	183,840	35.500	6,526,320.000	
	SEEK LTD	58,513	21.780	1,274,413.140	
	MINERAL RESOURCES LTD	28,865	58.350	1,684,272.750	
	BRAMBLES LTD	220,767	13.590	3,000,223.530	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	3.510	1,419,780.960	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.560	793,342.440	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	86,411	10.960	947,064.560	
	XERO LTD	23,149	99.930	2,313,279.570	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	23.510	1,056,139.730	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.590	1,336,929.300	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	4.830	1,128,481.200	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	443,450	25.470	11,294,671.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD-RTS	9,144	0.275	2,514.600	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.490	1,440,500.990	
	SOUTH32 LTD (AUD)	682,738	3.150	2,150,624.700	
	COLES GROUP LTD	197,589	15.410	3,044,846.490	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	62.220	1,325,908.200	
	オーストラリア・ドル 小計	10,277,962		231,465,734.590 (22,301,723,528)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	75,291	64.900	4,886,385.900	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	20.980	5,612,045.100	
	BANK OF MONTREAL	105,551	107.320	11,327,733.320	
	BANK OF NOVA SCOTIA	176,307	58.950	10,393,297.650	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	88.650	4,583,736.900	
	BCE INC	14,197	53.120	754,144.640	
	BROOKFIELD CORP	211,045	44.220	9,332,409.900	
	SAPUTO INC	34,582	27.350	945,817.700	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	7.730	713,564.030	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	107.320	1,235,038.560	
	CGI INC	31,091	137.750	4,282,785.250	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	53.960	1,136,289.680	
	CAE INC	40,808	30.130	1,229,545.040	
	CAMECO CORP	66,084	58.680	3,877,809.120	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	56.930	3,038,638.750	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	136,114	51.980	7,075,205.720	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,344	89.090	14,641,406.960	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	140.310	1,250,302.410	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	30.710	501,494.300	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,693	154.140	12,900,439.020	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	46.740	1,408,837.080	
	OPEN TEXT CORP	40,459	50.530	2,044,393.270	

EMPIRE CO LTD	20,608	40.530	835,242.240	
KINROSS GOLD CORP	192,737	7.150	1,378,069.550	
RB GLOBAL INC	26,641	82.990	2,210,936.590	
FORTIS INC	72,078	55.700	4,014,744.600	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	16.280	1,390,653.880	
TELUS CORP	31,890	23.790	758,663.100	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	40.570	1,387,818.560	
IMPERIAL OIL LTD	27,434	77.280	2,120,099.520	
ENBRIDGE INC	314,754	46.100	14,510,159.400	
IGM FINANCIAL INC	12,478	32.430	404,661.540	
MANULIFE FINANCIAL CORP	271,363	25.790	6,998,451.770	
LOBLAW CO LTD	24,803	121.310	3,008,851.930	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	116,251	78.650	9,143,141.150	
MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	72.620	3,070,300.980	
SUN LIFE FINANCIAL INC	84,814	65.720	5,573,976.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,133	1,242.770	3,893,598.410	
METRO INC	35,059	74.530	2,612,947.270	
EMERA INC	44,643	48.080	2,146,435.440	
ONEX CORP	10,157	85.500	868,423.500	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	18.380	1,017,755.740	
POWER CORP OF CANADA	89,864	34.090	3,063,463.760	
QUEBECOR INC-B	30,598	31.060	950,373.880	
ROYAL BANK OF CANADA	203,329	116.780	23,744,760.620	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	138,820	97.540	13,540,502.800	
STANTEC INC	18,358	94.660	1,737,768.280	
SUNCOR ENERGY INC	198,439	45.780	9,084,537.420	
LUNDIN MINING CORP	77,139	8.360	644,882.040	
TECK RESOURCES LTD-CL B	65,896	48.790	3,215,065.840	
THOMSON REUTERS CORP	22,378	180.580	4,041,019.240	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	112.990	1,479,830.030	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	270,486	81.960	22,169,032.560	
TC ENERGY CORP	145,828	49.490	7,217,027.720	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	101.030	818,545.060	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	165.280	1,626,189.920	
INTACT FINANCIAL CORP	26,758	206.370	5,522,048.460	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	66,562	59.310	3,947,792.220	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,041	3,034.000	9,226,394.000	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	164.690	4,845,179.800	
TOURMALINE OIL CORP	49,085	68.410	3,357,904.850	
KEYERA CORP	39,997	31.820	1,272,704.540	
PARKLAND CORP	15,665	43.520	681,740.800	
ALTAGAS LTD	47,249	26.390	1,246,901.110	

	PEMBINA PIPELINE CORP	82,164	43.940	3,610,286.160	
	DOLLARAMA INC	41,508	98.870	4,103,895.960	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	204,922	24.920	5,106,656.240	
	ARC RESOURCES LTD	96,301	21.690	2,088,768.690	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	21.570	736,658.640	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	20.510	1,050,993.930	
	TMX GROUP LTD	46,884	29.200	1,369,012.800	
	BRP INC	4,307	97.020	417,865.140	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	10.000	988,200.000	
	NUTRIEN LTD	71,301	73.850	5,265,578.850	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	153.790	1,782,579.890	
	WSP GLOBAL INC	17,782	188.900	3,359,019.800	
	IA FINANCIAL CORP INC	16,448	85.080	1,399,395.840	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	39.630	1,413,483.210	
	NUVEI CORP	7,929	25.640	203,299.560	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	32.430	522,220.290	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	42.840	2,238,347.160	
	AIR CANADA	41,858	18.110	758,048.380	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	94.790	4,276,261.270	
	SHOPIFY INC	179,237	84.670	15,175,996.790	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	198.760	1,040,906.120	
	HYDRO ONE LTD	46,225	37.640	1,739,909.000	
	カナダ・ドル 小計	6,015,517		352,597,300.220 (38,736,339,402)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.760	645,968.000	
	SEBMCORP INDUSTRIES	162,200	5.050	819,110.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	268,710	33.170	8,913,110.700	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,000	6.070	613,070.000	
	SEATRUM LTD	7,235,222	0.108	781,403.970	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	28.960	448,880.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.710	1,358,429.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.850	647,014.050	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.260	1,157,474.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	502,098	12.970	6,512,211.060	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,131,630	2.360	2,670,646.800	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.210	1,515,240.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	27.400	5,248,908.400	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	5.970	260,292.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.590	928,015.000	
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.940	1,191,552.600		
	シンガポール・ドル 小計	11,817,109		33,711,325.580	

				(3,759,487,029)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	73.440	1,743,024.960	
	NESTLE SA-REGISTERED	395,086	99.380	39,263,646.680	
	CIE FINANC RICHEMONT	77,733	106.700	8,294,111.100	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	104,214	236.750	24,672,664.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	191.350	1,016,259.850	
	SIKA INHABER	22,077	225.000	4,967,325.000	
	SGS SA-REG	22,978	75.220	1,728,405.160	
	NOVARTIS AG-REG SHS	303,021	83.860	25,411,341.060	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	131.000	763,730.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,425.000	655,500.000	
	CLARIANT AG-REG	22,909	13.300	304,689.700	
	SWISSCOM AG-REG	3,604	512.200	1,845,968.800	
	ABB LTD	238,635	32.140	7,669,728.900	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	39.670	1,049,430.180	
	GEBERIT AG	5,105	460.000	2,348,300.000	
	LONZA GROUP AG-REG	10,855	334.600	3,632,083.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,540.000	1,443,980.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	104,200.000	1,667,200.000	
	GIVAUDAN-REG	1,392	3,180.000	4,426,560.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,160	431.000	9,550,960.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	251.600	1,210,196.000	
	HOLCIM LTD	77,519	59.980	4,649,589.620	
	TEMENOS GROUP	10,930	66.840	730,561.200	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	71.900	335,988.700	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	226.900	1,837,890.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	239.800	1,892,022.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,475	113.150	1,864,146.250	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	227.500	978,250.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	43.650	404,155.350	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	123.000	603,438.000	
	SCHINDLER NAMEN	4,209	183.700	773,193.300	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	551.600	2,483,854.800	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	100.300	491,770.900	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	607.000	755,715.000	
	SWISS PRIME SITE AG	9,861	83.900	827,337.900	
	AVOLTA AG	12,933	29.340	379,454.220	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,050.000	3,604,650.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	51.800	1,663,505.200	
	SWISS RE LTD	45,502	97.960	4,457,375.920	
	BKW AG	3,194	154.500	493,473.000	
SIG GROUP AG	50,969	20.620	1,050,980.780		
ALCON INC	74,922	64.940	4,865,434.680		
SANDOZ GROUP AG	57,347	24.480	1,403,854.560		
UBS GROUP AG	487,869	22.020	10,742,875.380		
VAT GROUP AG	4,131	352.600	1,456,590.600		

スイス・フラン	小計	2,237,708		192,411,212.250 (32,332,780,106)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	396,072	152.000	60,202,944.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	132.050	31,938,801.450	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	50.330	21,037,940.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	205.500	5,292,652.500	
	LUNDBERGS B	14,872	462.100	6,872,351.200	
	SKF AB-B SHS	46,594	182.800	8,517,383.200	
	SANDVIK AB	169,218	195.500	33,082,119.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	124.000	27,571,152.000	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	154.350	6,781,675.950	
	SWEDBANK AB	115,534	180.050	20,801,896.700	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	156.000	14,476,020.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	96.100	21,031,100.600	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	228.600	5,531,662.800	
	VOLVO AB-B SHS	219,089	221.600	48,550,122.400	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	421.600	7,302,112.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	79.900	5,405,554.600	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	292.300	4,469,851.600	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	292.500	6,237,562.500	
	SAAB AB-B	11,789	561.600	6,620,702.400	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	87.220	6,636,133.700	
	INVESTOR AB-B SHS	243,361	206.900	50,351,390.900	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	155.160	16,240,442.040	
	ASSA ABLOY AB-B	153,368	245.300	37,621,170.400	
	TELIA CO AB	344,810	24.080	8,303,024.800	
	BOLIDEN AB	36,260	274.900	9,967,874.000	
	ALFA LAVAL AB	44,407	367.500	16,319,572.500	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	54.920	4,005,974.640	
	INDUTRADE AB	39,178	205.500	8,051,079.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	74.200	3,544,459.800	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	65.340	13,906,442.880	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	236.200	8,593,192.200	
	HEXAGON AB-B SHS	307,116	95.140	29,219,016.240	
	SAGAX AB	28,022	230.600	6,461,873.200	
EPIROC AB-A	103,115	185.750	19,153,611.250		
EPIROC AB-B	61,487	157.800	9,702,648.600		
ESSITY AB-B	86,900	250.400	21,759,760.000		
EQT AB	55,194	224.000	12,363,456.000		
VOLVO CAR AB	63,710	37.820	2,409,512.200		
BEIJER REF AB	50,493	109.600	5,534,032.800		
LIFCO AB	39,631	218.400	8,655,410.400		
EVOLUTION AB	28,266	998.100	28,212,294.600		
NORDEA BANK ABP	481,923	117.320	56,539,206.360		
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	208.000	5,748,704.000		

スウェーデン・クローナ 小計		5,128,064		731,023,887.410 (10,168,542,274)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	822.000	12,467,274.000	
	A P MOLLER A/S	663	9,988.000	6,622,044.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	9,905.000	5,378,415.000	
	DANSKE BANK A/S	102,303	165.350	16,915,801.050	
	GENMAB A/S	9,783	2,153.000	21,062,799.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	343.100	10,222,664.500	
	ROCKWOOL AS	873	1,620.000	1,414,260.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	484,214	691.600	334,882,402.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	167.060	25,814,278.260	
	COLOPLAST-B	21,291	697.400	14,848,343.400	
	DSV A/S	28,190	1,070.000	30,163,300.000	
	DEMANT A/S	11,367	261.900	2,977,017.300	
	TRYG A/S	58,222	140.550	8,183,102.100	
	PANDORA A/S	12,473	860.800	10,736,758.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	16,295	523.000	8,522,285.000	
ORSTED A/S	26,911	293.800	7,906,451.800		
デンマーク・クローネ 小計		972,611		518,117,196.210 (11,258,686,674)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.740	1,271,999.340	
	EBOS GROUP LTD	25,631	37.200	953,473.200	
	FISHER & PAYKEL	78,460	21.720	1,704,151.200	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.110	1,119,284.180	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.880	369,463.920	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	4.960	1,186,967.680	
ニュージーランド・ドル 小計		789,612		6,605,339.520 (589,922,873)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	188.100	10,604,137.500	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	60.520	13,385,934.640	
	TELENOR ASA	119,576	114.850	13,733,303.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	460.200	5,147,337.000	
	ORKLA ASA	116,068	78.320	9,090,445.760	
	EQUINOR ASA	129,895	364.300	47,320,748.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	364.300	7,225,526.200	
	AKER BP ASA	40,933	307.800	12,599,177.400	
	SALMAR ASA	12,897	568.600	7,333,234.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	169.000	4,346,849.000	
	ADEVINTA ASA	54,715	107.500	5,881,862.500	
	DNB BANK ASA	143,909	200.400	28,839,363.600	
ノルウェー・クローネ 小計		952,290		165,507,919.900 (2,257,528,027)	
ユーロ	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	25,137	138.800	3,489,015.600	
	KERRY GROUP PLC-A	25,025	72.460	1,813,311.500	

KINGSPAN GROUP PLC	21,860	66.080	1,444,508.800
UMICORE	33,545	22.770	763,819.650
AIR LIQUIDE	77,642	166.600	12,935,157.200
AIRBUS SE	88,164	128.480	11,327,310.720
AXA SA	271,713	27.725	7,533,242.920
VEOLIA ENVIRONNEMENT	98,192	27.030	2,654,129.760
ADIDAS AG	24,550	170.900	4,195,595.000
ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	19.105	2,762,831.360
DASSAULT AVIATION SA	3,120	182.900	570,648.000
DANONE	92,137	57.370	5,285,899.690
SAFRAN SA	51,062	153.080	7,816,570.960
INTESA SANPAOLO	2,330,103	2.566	5,979,044.290
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45,524	91.180	4,150,878.320
ACCOR SA	31,427	29.960	941,552.920
BOUYGUES	29,123	33.970	989,308.310
BNP PARIBAS	155,810	55.610	8,664,594.100
THALES SA	15,023	138.600	2,082,187.800
CAPGEMINI SA	25,063	171.850	4,307,076.550
LOTUS BAKERIES NV	77	7,350.000	565,950.000
UNICREDIT SPA	275,839	23.865	6,582,897.730
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	113.150	1,403,399.450
D' IETEREN TRDG	2,736	151.200	413,683.200
COMMERZBANK AG	158,792	10.660	1,692,722.720
EIFFAGE	12,706	86.160	1,094,748.960
FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	25.040	1,472,702.560
PUBLICIS GROUPE	33,467	70.360	2,354,738.120
IBERDROLA SA	899,504	10.650	9,579,717.600
ENI SPA	353,207	14.998	5,297,398.580
JERONIMO MARTINS	45,606	22.100	1,007,892.600
KESKO OYJ-B	35,252	16.420	578,837.840
KBC GROUPE	35,962	51.280	1,844,131.360
HANNOVER RUECK SE	8,405	202.100	1,698,650.500
WARTSILA OYJ	77,148	11.415	880,644.420
L' OREAL	35,752	414.250	14,810,266.000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	41,008	687.100	28,176,596.800
GEA GROUP AG	25,513	34.290	874,840.770
BOLLORE	114,808	5.270	605,038.160
MEDIOBANCA SPA	86,792	11.540	1,001,579.680
MICHELIN (CGDE) -B	98,359	28.480	2,801,264.320
CONTINENTAL AG	17,635	63.380	1,117,706.300
DEUTSCHE POST AG-REG	141,942	38.965	5,530,770.030
OMV AG	23,354	42.430	990,910.220
VERBUND AG	10,663	84.000	895,692.000
PERNOD-RICARD	30,948	164.300	5,084,756.400
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	43.780	1,020,555.580
RENAULT SA	27,902	34.005	948,807.510

REPSOL SA	195,049	13.645	2,661,443.600
REMY COINTREAU	2,866	108.650	311,390.900
MERCK KGAA	18,505	149.500	2,766,497.500
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	69,501	54.230	3,769,039.230
RWE AG	90,040	36.280	3,266,651.200
SEB SA	2,596	98.500	255,706.000
SOCIETE GENERALE-A	104,069	21.260	2,212,506.940
VINCI S. A.	78,581	106.560	8,373,591.360
SODEXO	12,910	99.800	1,288,418.000
SOFINA	2,281	191.900	437,723.900
SOLVAY SA	11,217	99.340	1,114,296.780
SCHNEIDER ELECTRIC SE	81,059	160.800	13,034,287.200
VIVENDI SE	98,944	8.578	848,741.630
SAP SE	155,241	134.860	20,935,801.260
TELEFONICA S. A	755,720	3.706	2,800,698.320
TOTALENERGIES SE	332,576	62.040	20,633,015.040
VALEO	26,570	12.385	329,069.450
E. ON SE	339,366	11.450	3,885,740.700
VOEST-ALPINE AG	18,032	24.780	446,832.960
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	61.920	1,107,501.120
SIEMENS AG-REG	113,016	130.800	14,782,492.800
UPM-KYMMENE OYJ	77,973	32.400	2,526,325.200
ING GROEP NV-CVA	540,815	12.160	6,576,310.400
PUMA AG	17,210	54.360	935,535.600
BAYER AG	147,329	40.155	5,915,995.990
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	11.915	1,143,601.700
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	70.700	1,710,303.700
MERCEDES-BENZ GROUP AG	119,618	56.490	6,757,220.820
BASF SE	135,442	43.715	5,920,847.030
BEIERSDORF AG	15,743	123.700	1,947,409.100
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	70.140	1,514,042.040
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	33,632	31.980	1,075,551.360
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	437.050	2,906,819.550
ORANGE	286,957	11.052	3,171,448.760
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	38.620	2,474,769.600
RANDSTAD NV	15,584	51.840	807,874.560
ALLIANZ SE	59,640	222.000	13,240,080.000
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	433,193	4.153	1,799,050.520
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	26.750	3,923,342.250
HERMES INTL	4,712	1,845.400	8,695,524.800
ENDESA S. A.	50,946	18.620	948,614.520
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.560	546,905.520
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	33.860	1,546,927.960
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	20,381	371.400	7,569,503.400
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	20.285	1,645,701.760

DASSAULT SYSTEMES SA	101,597	40.490	4,113,662.530
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	33.260	1,158,645.360
RHEINMETALL STAMM	6,662	273.600	1,822,723.200
HEINEKEN NV	43,759	84.720	3,707,262.480
AKZO NOBEL	26,032	65.940	1,716,550.080
ASML HOLDING NV	59,922	608.000	36,432,576.000
AEGON LTD	232,433	4.696	1,091,505.360
VOLKSWAGEN AG	3,315	114.600	379,899.000
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	103.660	3,153,855.500
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	885,310	7.900	6,993,949.000
KERING	10,616	393.100	4,173,149.600
ACCIONA S. A.	5,005	127.200	636,636.000
FORTUM OYJ	54,194	12.185	660,353.890
AGEAS	24,086	37.530	903,947.580
UCB SA	16,732	65.780	1,100,630.960
NEMETSCHEK SE	10,222	73.240	748,659.280
CARREFOUR SA	90,642	17.105	1,550,431.410
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.580	469,854.660
NOKIA OYJ	827,068	3.241	2,680,527.380
KONINKLIJKE PHILIPS NV	134,920	18.404	2,483,067.680
WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	123.750	4,792,095.000
SANOFI	169,265	85.140	14,411,222.100
STMICROELECTRONICS NV	97,199	38.615	3,753,339.380
ELISA OYJ	20,242	42.240	855,022.080
BANCO SANTANDER SA	2,412,875	3.609	8,708,065.870
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	14.770	968,749.530
QIAGEN N. V.	35,613	35.210	1,253,933.730
DEUTSCHE BANK AG-REG	282,637	10.496	2,966,557.950
BMW VORZUG	7,821	83.150	650,316.150
ENEL SPA	1,202,825	6.129	7,372,114.420
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	482,293	21.435	10,337,950.450
SARTORIUS AG	3,651	251.400	917,861.400
INFINEON TECHNOLOGIES AG	197,936	29.305	5,800,514.480
RATIONAL AG	542	589.500	319,509.000
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	84.520	411,274.320
BECHTLE AG	14,521	43.100	625,855.100
KONINKLIJKE KPN NV	496,095	3.200	1,587,504.000
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	49.670	1,144,297.460
TELEPERFORMANCE	7,845	125.450	984,155.250
DEUTSCHE BOERSE AG	28,751	165.850	4,768,353.350
EURAZEO	5,673	56.350	319,673.550
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	72.160	932,162.880
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	71.700	1,268,373.000
INDITEX	162,141	34.270	5,556,572.070
ESSILORLUXOTTICA	43,937	174.900	7,684,581.300
SNAM SPA	317,518	4.348	1,380,568.260

CREDIT AGRICOLE SA	166,921	11.710	1,954,644.910
ENAGAS	38,270	15.835	606,005.450
WENDEL	5,449	74.600	406,495.400
TENARIS SA	76,002	16.090	1,222,872.180
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.252	228,888.070
TERNA SPA	207,655	7.342	1,524,603.010
BIOMERIEUX	4,870	92.780	451,838.600
GRIFOLS SA	31,982	11.535	368,912.370
NESTE OYJ	66,248	32.880	2,178,234.240
RECORDATI SPA	18,197	44.260	805,399.220
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	10.540	884,727.600
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	182.050	1,327,872.700
KONE OYJ	49,300	41.840	2,062,712.000
ELIA GROUP	4,078	94.550	385,574.900
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	185.000	713,175.000
ENGIE	257,242	15.298	3,935,288.110
ALSTOM	47,494	13.105	622,408.870
IPSEN SA	5,964	104.300	622,045.200
ARKEMA SA	10,489	90.400	948,205.600
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	119.050	356,078.550
LEGRAND SA	41,105	83.600	3,436,378.000
AMPLIFON SPA	20,249	27.100	548,747.900
ADP	3,975	110.100	437,647.500
ORION OYJ	13,559	36.710	497,750.890
METSO CORPORATION	102,831	8.662	890,722.120
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	13.760	1,095,089.600
SYMRISE AG	19,547	96.280	1,881,985.160
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	32.400	1,291,755.600
PRYSMIAN SPA	38,343	34.840	1,335,870.120
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	84.820	206,027.780
CAIXABANK	630,095	3.856	2,429,646.320
BUREAU VERITAS SA	39,729	22.060	876,421.740
GETLINK	63,968	15.560	995,342.080
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	15.470	613,973.360
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	60.260	4,148,780.480
BRENTAG SE	21,559	71.700	1,545,780.300
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	18.055	773,403.980
EDENRED	35,618	49.420	1,760,241.560
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	2.348	322,699.720
TALANX AG	6,683	59.450	397,304.350
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	65.940	785,675.100
VONOVIA SE	107,478	23.230	2,496,713.940
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	8.454	1,387,774.820
KNORR-BREMSE AG	10,342	54.320	561,777.440
OCI NV	12,329	21.220	261,621.380
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	47.610	1,891,878.570

FERRARI NV	18,850	314.700	5,932,095.000	
ASR NEDERLAND NV	27,365	35.320	966,531.800	
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	9.280	1,334,853.760	
AIB GROUP PLC	226,914	4.158	943,508.410	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	31.460	544,037.780	
MONCLER SPA	29,763	49.460	1,472,077.980	
NEXI SPA	83,576	6.586	550,431.530	
PROSUS NV	228,638	28.415	6,496,748.770	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	87.420	1,326,511.080	
JDE PEET'S BV	14,385	25.720	369,982.200	
EXOR NV	14,142	83.780	1,184,816.760	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	9.390	703,235.880	
EURONEXT NV	14,077	71.600	1,007,913.200	
IMCD NV	9,332	126.800	1,183,297.600	
WORLDLINE SA	36,232	12.755	462,139.160	
NN GROUP NV	36,289	30.990	1,124,596.110	
FINECOBANK SPA	96,393	11.765	1,134,063.640	
ARGENX SE	8,001	454.300	3,634,854.300	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	114,291	23.500	2,685,838.500	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,616	28.220	2,133,883.520	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	26.540	260,675.880	
DSM-FIRMENICH AG	28,846	92.230	2,660,466.580	
ZALANDO SE	31,321	21.420	670,895.820	
STELLANTIS NV	327,741	17.982	5,893,438.660	
FERROVIAL SE	73,817	28.800	2,125,929.600	
AENA SME SA	9,989	147.300	1,471,379.700	
CELLNEX TELECOM SAU	81,974	30.430	2,494,468.820	
ABN AMRO BANK NV	52,835	12.085	638,510.970	
SCOUT24 SE	10,048	62.320	626,191.360	
COVESTRO AG	27,558	47.180	1,300,186.440	
HELLOFRESH SE	17,856	19.845	354,352.320	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	129,506	55.410	7,175,927.460	
POSTE ITALIANE SPA	61,361	9.882	606,369.400	
AMUNDI SA	11,288	53.150	599,957.200	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.650	446,011.350	
ADYEN NV	3,176	936.000	2,972,736.000	
DELIVERY HERO SE	22,564	27.285	615,658.740	
ユーロ 小計	26,104,990		666,924,808.990 (108,088,503,793)	
香港・ドル				
HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	10.300	2,647,100.000	
CLP HOLDINGS LTD	241,796	57.600	13,927,449.600	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	36.000	3,359,304.000	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	183,491	282.600	51,854,556.600	
MTR CORP	207,441	28.650	5,943,184.650	

HANG SENG BANK LTD	122,096	86.750	10,591,828.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	20.650	6,153,121.800	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	38.250	8,140,365.000	
HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.300	8,142,951.800	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	41.250	13,897,290.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	20.550	10,254,347.250	
NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	14.540	2,516,379.640	
SINO LAND CO	659,200	7.960	5,247,232.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	76.900	15,731,048.500	
SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	49.900	2,645,698.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	72.000	15,491,232.000	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	8.930	1,589,540.000	
AIA GROUP LTD	1,729,116	69.350	119,914,194.600	
HKT TRUST / HKT LTD	463,136	8.100	3,751,401.600	
SANDS CHINA LTD	335,800	20.500	6,883,900.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	11.780	1,649,200.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	14.880	2,999,808.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	25.650	6,569,862.750	
ESR GROUP LTD	465,200	9.990	4,647,348.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	15.120	4,006,800.000	
WH GROUP LTD	1,001,000	4.620	4,624,620.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	38.800	14,334,466.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	37.950	10,102,100.250	
香港・ドル 小計	10,963,869		357,616,330.040 (6,944,909,129)	
合計	167,263,181		1,145,801,688,216 (1,145,801,688,216)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年11月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計		2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券	合計		2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,161,042.120	
		GOODMAN GROUP	255,895.000	5,757,637.500	
		GPT GROUP	349,447.000	1,355,854.360	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	933,141.160	

		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,104,907.700	
		STOCKLAND	369,843.000	1,409,101.830	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	973,976.320	
	オーストラリア・ドル	小計	2,985,154.000	13,695,660.990 (1,319,576,937)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,409,143.490	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,643,799.820	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	730,114.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	539,315.000	
	シンガポール・ドル	小計	2,277,909.000	4,322,372.310 (482,030,960)	
投資信託受益証券 合計			5,263,063	1,801,607,897 (1,801,607,897)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,234.000	2,318,224.440	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,779,725.500	
		AMERICAN TOWER CORP	69,325.000	12,741,241.750	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,364,423.130	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,503.000	3,280,404.600	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,283,364.120	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,490,302.440	
		CROWN CASTLE INC	65,066.000	6,222,912.240	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	41,585.000	5,354,068.750	
		EQUINIX INC	13,861.000	10,635,129.470	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,791,861.400	
		EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	2,950,832.160	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,083,960.450	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	30,376.000	3,618,085.360	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,574,564.250	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	67,654.000	982,336.080	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,133.000	1,436,720.020	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	1,811,910.150	
		INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,741,302.080	
		IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	2,592,535.040	
		KIMCO REALTY	95,524.000	1,709,879.600	
		MID AMERICA	17,537.000	2,152,140.640	
		PROLOGIS INC	136,638.000	14,285,502.900	
		PUBLIC STORAGE	23,534.000	5,760,652.520	
		REALTY INCOME CORP	100,840.000	5,048,050.400	
		REGENCY CENTERS CORP	21,907.000	1,324,278.150	

	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	3,621,875.610	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	46,584.000	5,372,532.720	
	SUN COMMUNITIES INC	18,509.000	2,123,352.480	
	UDR INC	50,449.000	1,652,709.240	
	VENTAS INC	60,757.000	2,585,817.920	
	VICI PROPERTIES INC	140,502.000	3,998,686.920	
	WELLTOWER INC	73,965.000	6,359,510.700	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,084,797.250	
	WP CAREY INC	32,996.000	1,786,073.480	
アメリカ・ドル	小計	1,899,511.000	128,919,763.960 (19,558,417,390)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	727,827.310	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,277,726.940	
イギリス・ポンド	小計	286,426.000	2,005,554.250 (371,930,036)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	392,228.340	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	249,246.720	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	641,475.060 (70,472,450)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	214,697.080	
	GECINA SA	8,697.000	843,174.150	
	KLEPIERRE	36,407.000	821,341.920	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,477.000	933,827.580	
	WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	493,979.920	
ユーロ	小計	88,793.000	3,307,020.650 (535,968,837)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	15,809,971.800	
香港・ドル	小計	410,116.000	15,809,971.800 (307,029,652)	
投資証券	合計	2,707,992	20,843,818,365 (20,843,818,365)	
合計			22,645,426,262 (22,645,426,262)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証 券 時価比 率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 604銘柄	72.59	—	—	—	75.20
	投資証券 35銘柄	—	—	—	1.65	

イギリス・ポンド	株式	81銘柄	4.14	—	—	—	4.23
	投資証券	2銘柄	—	—	—	0.03	
イスラエル・シェケル	株式	8銘柄	0.10	—	—	—	0.10
オーストラリア・ドル	株式	52銘柄	1.88	—	—	—	2.02
	投資信託受益証券	7銘柄	—	—	0.11	—	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.27	—	—	—	3.32
	新株予約権証券	1銘柄	—	0.00	—	—	
	投資証券	2銘柄	—	—	—	0.01	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.32	—	—	—	0.36
	投資信託受益証券	4銘柄	—	—	0.04	—	
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.73	—	—	—	2.77
スウェーデン・クローナ	株式	43銘柄	0.86	—	—	—	0.87
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.95	—	—	—	0.96
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.05	—	—	—	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.19	—	—	—	0.19
ユーロ	株式	222銘柄	9.13	—	—	—	9.30
	投資証券	5銘柄	—	—	—	0.05	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.59	—	—	—	0.62
	投資証券	1銘柄	—	—	—	0.03	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年11月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,055,225,598
コール・ローン	283,678,559
国債証券	93,042,981,653
派生商品評価勘定	131,849
未収利息	521,679,794
前払費用	395,042,628
流動資産合計	107,298,740,081
資産合計	107,298,740,081
負債の部	
流動負債	
未払金	11,865,767,051
未払解約金	5,826,000
流動負債合計	11,871,593,051
負債合計	11,871,593,051
純資産の部	
元本等	
元本	43,140,270,331
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	52,286,876,699
元本等合計	95,427,147,030
純資産合計	95,427,147,030
負債純資産合計	107,298,740,081

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11月12日 至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	61,928,920,109円
同期中追加設定元本額	63,293,127,695円
同期中一部解約元本額	82,081,777,473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)	108,470,410円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,041,719,720円
たわらノーロード バランス (堅実型)	186,908,425円
たわらノーロード バランス (標準型)	571,277,569円
たわらノーロード バランス (積極型)	251,651,758円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	948,316円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	5,424,450円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	68,943,649円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,573,245円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	5,854,126円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	66,803,835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)	409,557,576円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	787,782,923円
投資のソムリエ	13,704,760,060円
クルーズコントロール	272,911,588円
投資のソムリエ<DC年金>	1,246,675,476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	1,404,199,550円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,887,403,377円
ワールドアセットバランス (基本コース)	365,283,783円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	598,582,842円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	66,981,644円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	33,550,337円

リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	11,399,321円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	234,928,146円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	636,543,386円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	225,982,841円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	84,562,856円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	36,692,148円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	22,242,578円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,333,982円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	4,403,336円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	17,049,634円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	9,549,397,276円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	407,993,238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)	536,375,782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)	142,769,168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)	6,378,643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)	114,406,217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)	66,312,541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)	2,365,710,370円
計	43,140,270,331円
2. 受益権の総数	43,140,270,331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11月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク (価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

<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11月13日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	△2,462,601,584	
合計	△2,462,601,584	

(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(2023年4月19日から2023年11月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年11月13日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	56,000,000	—		56,131,849	131,849
	56,000,000	—		56,131,849	131,849
合計	56,000,000	—		56,131,849	131,849

(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11月13日現在
1口当たり純資産額	2,2120円
(1万口当たり純資産額)	(22,120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11月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT' L 1.625 06/02/28	4,000,000.000	3,448,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.7 03/02/31	5,000,000.000	4,001,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.875 09/15/31	9,000,000.000	7,195,410.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.125 09/30/24	8,000,000.000	7,763,064.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.5 04/16/25	8,000,000.000	7,678,984.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.5 09/30/29	3,000,000.000	2,627,826.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,158,328.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.125 04/16/30	6,000,000.000	5,383,938.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.125 09/30/49	4,000,000.000	2,570,716.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.875 04/16/50	5,000,000.000	3,697,150.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	8,592,495.300	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	12,000,000.000	10,143,796.320	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	7,000,000.000	6,106,756.110	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	6,000,000.000	5,595,363.780	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	7,000,000.000	4,824,725.640	
		BRAZIL 6.0 10/20/33	8,000,000.000	7,563,991.360	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,603,714.580	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,596,736.160	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	967,998.380	

COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	5,485,462.360	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	6,000,000.000	4,508,474.520	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	11,000,000.000	8,031,785.520	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	4,000,000.000	2,301,966.240	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	2,000,000.000	1,929,656.860	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	4,000,000.000	2,687,699.120	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	8,000,000.000	7,720,564.640	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	5,000,000.000	5,043,471.750	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	6,000,000.000	5,172,481.440	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	8,000,000.000	6,603,591.440	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	12,000,000.000	11,073,513.720	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	6,000,000.000	4,441,086.720	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	6,200,000.000	5,596,686.800	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	10,000,000.000	8,152,186.300	
HUNGARY 2.125 09/22/31	12,000,000.000	8,874,192.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	3,416,250.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	7,000,000.000	6,656,755.000	
HUNGARY 5.375 03/25/24	3,380,000.000	3,378,411.400	
HUNGARY 6.125 05/22/28	6,000,000.000	5,986,182.000	
HUNGARY 6.25 09/22/32	9,000,000.000	8,862,300.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,506,647.710	
INDONESIA 3.05 03/12/51	4,000,000.000	2,569,642.880	
INDONESIA 3.4 09/18/29	200,000.000	179,696.360	
INDONESIA 3.5 01/11/28	1,200,000.000	1,115,337.380	
INDONESIA 3.85 10/15/30	8,400,000.000	7,654,526.370	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,170,663.370	
INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	5,396,540.030	
INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,552,785.370	
INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	986,953.540	
INDONESIA 7.75 01/17/38	500,000.000	585,968.550	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	6,000,000.000	5,897,070.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	7,000,000.000	6,915,440.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	4,000,000.000	3,972,460.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	6,000,000.000	4,122,361.680	
PANAMA 3.16 01/23/30	11,000,000.000	8,953,056.640	
PANAMA 3.87 07/23/60	4,000,000.000	2,167,819.040	
PANAMA 4.5 01/19/63	8,000,000.000	4,803,656.480	
PANAMA 4.5 04/01/56	8,000,000.000	4,909,267.520	
PANAMA 6.4 02/14/35	5,000,000.000	4,585,916.150	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,013,011.340	
PERU 2.392 01/23/26	3,000,000.000	2,791,679.010	

PERU 2.78 12/01/60	4,000,000.000	2,113,834.200	
PERU 2.783 01/23/31	6,000,000.000	4,893,185.880	
PERU 3.0 01/15/34	11,000,000.000	8,494,150.830	
PERU 3.55 03/10/51	7,000,000.000	4,572,403.570	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	1,600,000.000	1,226,242.640	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	6,000,000.000	3,651,256.440	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	1,000,000.000	913,964.920	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	7,000,000.000	4,632,876.080	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,200,000.000	4,829,222.260	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	4,200,000.000	3,442,369.810	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	5,780,151.000	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	4,000,000.000	3,073,753.200	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	6,200,000.000	5,709,906.670	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	4,000,000.000	2,251,140.480	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	11,000,000.000	7,439,922.490	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	3,000,000.000	1,972,485.120	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	7,200,000.000	5,921,197.120	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,238,739.550	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	5,000,000.000	3,992,766.100	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	8,000,000.000	7,639,397.600	
ROMANIA 3.0 02/14/31	1,000,000.000	815,182.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	13,000,000.000	8,528,533.000	
ROMANIA 7.125 01/17/33	14,000,000.000	14,384,510.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	11,000,000.000	8,503,803.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	6,000,000.000	5,714,136.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	13,200,000.000	11,583,660.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	2,000,000.000	1,215,500.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	3,400,000.000	2,250,684.400	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	13,000,000.000	12,423,177.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,819,760.000	

SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	3,028,664.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	6,000,000.000	5,883,672.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	5,000,000.000	4,773,730.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	3,000,000.000	2,479,668.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	5,000,000.000	4,317,655.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	7,000,000.000	7,032,284.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	11,000,000.000	9,526,220.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	1,400,000.000	1,341,214.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	12,000,000.000	8,114,016.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	2,000,000.000	1,787,260.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	9,000,000.000	7,292,196.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,799,800.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	8,000,000.000	7,453,072.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	13,000,000.000	12,406,888.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	7,000,000.000	5,658,800.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	16,000,000.000	13,759,344.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	2,000,000.000	1,785,600.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	5,000,000.000	3,135,420.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	3,000,000.000	2,793,483.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	1,000,000.000	987,434.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	8,000,000.000	6,364,955.280	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	5,000,000.000	4,280,901.100	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	7,000,000.000	5,493,275.200	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	4,000,000.000	2,328,888.480	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,376,312.680	
UNITED MEXICAN STATES	2,600,000.000	2,548,984.640	

	3.9 04/27/25			
	UNITED MEXICAN STATES	8,000,000.000	5,945,806.320	
	4.28 08/14/41			
	UNITED MEXICAN STATES	3,000,000.000	2,086,165.620	
	4.4 02/12/52			
	UNITED MEXICAN STATES	4,000,000.000	2,892,439.040	
	4.5 01/31/50			
	UNITED MEXICAN STATES	7,000,000.000	6,578,233.760	
	4.5 04/22/29			
	UNITED MEXICAN STATES	4,000,000.000	3,619,772.080	
	4.75 04/27/32			
	UNITED MEXICAN STATES	6,000,000.000	5,395,241.340	
	4.875 05/19/33			
	UNITED MEXICAN STATES	3,000,000.000	2,312,086.530	
	5.0 04/27/51			
	UNITED MEXICAN STATES	5,000,000.000	4,512,763.400	
	6.338 05/04/53			
	UNITED MEXICAN STATES	5,000,000.000	4,880,813.850	
	6.35 02/09/35			
	アメリカ・ドル 小計	740,080,000.000 (112,277,536,800)	613,294,981.560 (93,042,981,653)	
国債証券 合計		112,277,536,800 (112,277,536,800)	93,042,981,653 (93,042,981,653)	
合計			93,042,981,653 (93,042,981,653)	

(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 125銘柄	97.50	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。

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11月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,663,263,514
コール・ローン	268,703,789
株式	82,529,973,979
投資信託受益証券	707,176,723
投資証券	83,512,367
派生商品評価勘定	77,984,911
未収配当金	110,866,263
差入委託証拠金	1,433,570,078
流動資産合計	88,875,051,624
資産合計	88,875,051,624
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,111,778
未払金	616,003,679
未払解約金	9,541,000
流動負債合計	673,656,457
負債合計	673,656,457
純資産の部	
元本等	
元本	57,474,248,034
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	30,727,147,133
元本等合計	88,201,395,167
純資産合計	88,201,395,167
負債純資産合計	88,875,051,624

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11月12日 至 2023年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年11月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	69,564,245,495円
同期中追加設定元本額	43,260,199,454円
同期中一部解約元本額	55,350,196,915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>	9,655,457,960円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>	3,798,307,429円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,706,266円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	10,890,256円

MI TO ラップ型ファンド (積極型)	28,477,981円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	38,306,321円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	33,202,050円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	24,057,455円
たわらノーロード 新興国株式	12,547,628,850円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,974,610,517円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	4,364,114,796円
たわらノーロード バランス (堅実型)	33,433,863円
たわらノーロード バランス (標準型)	134,787,043円
たわらノーロード バランス (積極型)	239,513,514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)	100,312,128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)	173,835,043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)	262,175,198円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	71,286円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,959,399円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,641,308円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	8,471,746円
たわらノーロード 全世界株式	739,487,940円
One DC 新興国株式インデックスファンド	1,051,589,138円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	371,841,535円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	400,914,931円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	591,176,546円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	1,124,840,639円
投資のソムリエ	9,950,998,235円
クルーズコントロール	386,080,520円
投資のソムリエ<DC年金>	903,547,831円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	449,449,869円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	871,158,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,038,860,042円
ワールドアセットバランス (基本コース)	535,942,539円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,000,625,399円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	45,160,451円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	22,624,677円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	7,004,197円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	145,005,761円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,380,275,460円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	319,834,038円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	61,367,086円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	24,739,658円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	15,003,437円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	3,598,852円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	24,539,150円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	294,754,204円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	4,576,527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)	165,719,534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)	96,021,287円
計	57,474,248,034円

2. 受益権の総数

57,474,248,034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11月12日 至 2023年11月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年11月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年11月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)

株式	△2,851,532,123
投資信託受益証券	84,134,591
投資証券	2,530,907
合計	△2,764,866,625

(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（2023年4月19日から2023年11月13日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年11月13日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売建	92,975	—	93,719	△744	
ブラジル・リアル	92,975	—	93,719	△744	
買建	107,083,285	—	107,335,784	252,499	
アメリカ・ドル	107,083,285	—	107,335,784	252,499	
合計	107,176,260	—	107,429,503	251,755	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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11月13日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引					
先物取引					
買建	4,842,090,142	—	4,871,711,520	29,621,378	
合計	4,842,090,142	—	4,871,711,520	29,621,378	

(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11月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5346円 (15,346円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年11月13日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,977	8.920	160,354.840	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	5,736	122.530	702,832.080	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,502	70.670	530,166.340	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	219,522	1.256	275,719.630	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	1.358	120,862.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	51,568	2.163	111,541.580	
	EFG HOLDING S. A. E. -GDR	62,824	0.635	39,893.240	
	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	27,140	14.290	387,830.600	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,410	9.400	332,854.000	
	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	17,858	34.810	621,636.980		

	JOYY INC-ADR	3,434	41.260	141,686.840	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,056	26.880	135,905.280	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	15.360	153,600.000	
	NIO INC ADR	118,812	7.240	860,198.880	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	60,221	7.370	443,828.770	
	AUTOHOME INC ADR	4,983	26.870	133,893.210	
	MINISO GROUP HOLDING LTD ADR	7,141	25.780	184,094.980	
	WEIBO CORP ADR	6,261	11.250	70,436.250	
	KANZHUN LTD ADR	19,195	14.790	283,894.050	
	KE HOLDINGS INC ADR	56,643	14.840	840,582.120	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,251	64.430	338,321.930	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	1.010	61,042.380	
	PDD HOLDINGS INC ADR	50,641	109.040	5,521,894.640	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	35,543	44.360	1,576,687.480	
	IQIYI INC ADR	33,439	4.830	161,510.370	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	36,322	24.120	876,086.640	
アメリカ・ドル	小計	307,402,599		15,067,355.110 (2,285,868,444)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	115,717	10.640	1,231,228.880	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	234,419	5.540	1,298,681.260	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	296,742	19.620	5,822,078.040	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	252,623	8.300	2,096,770.900	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	378,699	13.300	5,036,696.700	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	574,829	7.100	4,081,285.900	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	312,686	5.710	1,785,437.060	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	164,403	17.650	2,901,712.950	
	MULTIPLY GROUP	316,386	3.600	1,138,989.600	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	188,416	3.320	625,541.120	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	257,162	3.630	933,498.060	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	3,092,082		26,951,920.470 (1,115,000,950)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	257,162	2,314.900	595,304,313.800	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	59,189	384.050	22,731,535.450	
	ASIAN PAINTS LTD	32,571	3,076.450	100,203,052.950	
	BANK OF BARODA	92,818	194.850	18,085,587.300	

EICHER MOTORS LTD	11,150	3,540.750	39,479,362.500
GRASIM INDUSTRIES LTD	21,160	1,943.000	41,113,880.000
HDFC BANK LTD	234,638	1,491.500	349,962,577.000
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	79,516	1,524.100	121,190,335.600
SHREE CEMENT LTD	788	26,358.500	20,770,498.000
ICICI BANK LTD	435,384	938.600	408,651,422.400
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	42,590	299.550	12,757,834.500
STATE BANK OF INDIA LTD	150,140	579.500	87,006,130.000
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	25,636	736.850	18,889,886.600
TATA STEEL LTD	631,233	120.050	75,779,521.650
TATA MOTORS LTD	141,529	651.050	92,142,455.450
JSW STEEL LTD	49,199	754.750	37,132,945.250
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	47,991	912.700	43,801,385.700
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,047	7,138.600	14,612,714.200
TATA POWER CO LTD	114,167	251.400	28,701,583.800
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,830	4,681.950	41,341,618.500
NESTLE INDIA LTD	2,887	24,137.200	69,684,096.400
GAIL INDIA LTD	207,188	125.600	26,022,812.800
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	92,320	1,745.450	161,139,944.000
VEDANTA LTD	60,107	245.250	14,741,241.750
SUPREME INDUSTRIES LTD	5,773	4,247.950	24,523,415.350
AXIS BANK LTD	192,806	1,029.200	198,435,935.200
TITAN COMPANY LTD	30,268	3,256.350	98,563,201.800
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	271,481	195.900	53,183,127.900
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,435	2,107.350	24,097,547.250
BHARAT ELECTRONICS LTD	320,632	138.800	44,503,721.600
LUPIN LTD	18,765	1,180.150	22,145,514.750
MPHASIS LTD	6,694	2,202.200	14,741,526.800
BAJAJ FINANCE LTD	23,152	7,444.800	172,362,009.600
INFOSYS LTD	281,161	1,368.850	384,867,234.850
WIPRO LTD	106,724	379.300	40,480,413.200
TATA ELXSI LTD	3,020	8,055.050	24,326,251.000
MRF LTD	175	108,295.700	18,951,747.500
INDIAN OIL CORP LTD	225,534	98.050	22,113,608.700
HINDUSTAN UNILEVER LTD	69,486	2,486.550	172,780,413.300
TRENT LTD	16,156	2,489.350	40,217,938.600
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,789	5,278.500	46,392,736.500
CUMMINS INDIA LTD	12,335	1,768.450	21,813,830.750
HCL TECHNOLOGIES LTD	80,948	1,255.450	101,626,166.600
DABUR INDIA LTD	48,446	533.350	25,838,674.100
HERO MOTOCORP LTD	8,789	3,105.200	27,291,602.800
SRF LTD	11,697	2,351.200	27,501,986.400
BALKRISHNA INDUSTRIES	7,071	2,566.550	18,148,075.050

LTD				
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,326	5,424.900	50,592,617.400	
BHARTI AIRTEL LTD	189,029	935.500	176,836,629.500	
UNITED SPIRITS LTD	26,161	1,044.350	27,321,240.350	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	81,132	1,179.350	95,683,024.200	
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,597	3,493.200	33,524,240.400	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,533	10,388.800	119,814,030.400	
AUROBINDO PHARMA LTD	23,983	979.700	23,496,145.100	
HAVELLS INDIA LTD	19,728	1,257.400	24,805,987.200	
TVS MOTOR COMPANY LTD	19,289	1,631.950	31,478,683.550	
INDRAPRASTHA GAS LTD	27,995	394.150	11,034,229.250	
JINDAL STEEL & POWER LTD	27,284	636.900	17,377,179.600	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	214,409	88.400	18,953,755.600	
SHRIRAM FINANCE LTD	22,842	1,952.200	44,592,152.400	
PETRONET LNG LTD	64,449	194.700	12,548,220.300	
CIPLA LTD/INDIA	45,168	1,240.100	56,012,836.800	
LARSEN & TOUBRO LTD	58,337	3,033.250	176,950,705.250	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,712	8,710.850	84,599,775.200	
ASHOK LEYLAND LTD	131,250	173.800	22,811,250.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	77,213	3,333.450	257,385,674.850	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,830	2,205.100	30,496,533.000	
NTPC LTD	372,396	242.750	90,399,129.000	
YES BANK LTD	977,054	18.300	17,880,088.200	
AMBUJA CEMENTS LTD	52,658	418.100	22,016,309.800	
BHARAT FORGE LTD	23,256	1,040.500	24,197,868.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,664	481.300	47,968,283.200	
ITC LTD	253,125	436.550	110,501,718.750	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,991	2,432.350	29,166,308.850	
UNITED PHOSPHORUS LTD	40,105	547.150	21,943,450.750	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	9,505	2,058.200	19,563,191.000	
SIEMENS INDIA LTD	7,072	3,407.350	24,096,779.200	
INFO EDGE INDIA LTD	6,388	4,510.800	28,814,990.400	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	55,462	388.550	21,549,760.100	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	36,044	984.300	35,478,109.200	
TECH MAHINDRA LTD	46,476	1,138.150	52,896,659.400	
INDIAN HOTELS CO LTD	67,997	409.450	27,841,371.650	
MARICO LTD	46,494	521.250	24,234,997.500	
POWER FINANCE CORP LTD	119,321	287.700	34,328,651.700	
PAGE INDUSTRIES LTD	566	38,360.650	21,712,127.900	
ABB LTD/INDIA	4,777	4,239.300	20,251,136.100	
DLF LTD	49,742	606.050	30,146,139.100	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	398,123	211.150	84,063,671.450	

ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,610	808.600	34,454,446.000	
REC LTD	107,141	325.700	34,895,823.700	
BAJAJ FINSERV LTD	32,698	1,596.000	52,186,008.000	
BAJAJ AUTO LTD	5,519	5,392.050	29,758,723.950	
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	507.600	15,363,021.600	
ADANI POWER LTD	68,292	399.400	27,275,824.800	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,379	1,273.250	14,488,311.750	
COAL INDIA LTD	124,565	323.400	40,284,321.000	
PI INDUSTRIES LTD	7,267	3,687.350	26,795,972.450	
VARUN BEVERAGES LTD	36,637	1,009.050	36,968,564.850	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,498	3,195.750	27,157,483.500	
LTIMINDTREE LTD	7,277	5,262.150	38,292,665.550	
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,366	938.700	23,811,064.200	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	78,537	626.750	49,223,064.750	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	699.250	11,047,450.750	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	13,342	2,058.900	27,469,843.800	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,689	2,769.850	21,297,376.650	
BANDHAN BANK LTD	52,105	217.750	11,345,863.750	
GODREJ PROPERTIES LTD	9,790	1,817.650	17,794,793.500	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	33,265	1,148.250	38,196,536.250	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	22,115	753.450	16,662,546.750	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	18,362	672.450	12,347,526.900	
ZOMATO LTD	349,029	121.300	42,337,217.700	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	68,679	592.900	40,719,779.100	
SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	37,656	565.250	21,285,054.000	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	264,027	221.950	58,600,792.650	
ASTRAL POLYTECHNIK LTD	10,849	1,891.350	20,519,256.150	
BERGER PAINTS INDIA LTD	28,399	578.400	16,425,981.600	
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,233	3,798.400	50,264,227.200	
IDFC BANK LTD	313,776	85.350	26,780,781.600	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	21,438	1,352.250	28,989,535.500	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,024	530.100	17,506,022.400	
INTERGLOBE AVIATION LTD	10,946	2,501.750	27,384,155.500	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	38,685	1,355.400	52,433,649.000	
インド・ルピー 小計	10,270,320		7,181,882,753.650	

				(13,142,845,439)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	547,000	1,625,000	888,875,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,178,385	1,175,000	2,559,602,375.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	140,601	23,100,000	3,247,883,100.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	6,325,000	2,302,300,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	3,590,000	2,123,844,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,749,000	5,775,000	10,100,475,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,262,500	3,550,000	15,131,875,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	637,600	5,600,000	3,570,560,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	267,600	8,475,000	2,267,910,000.000	
	BANK MANDIRI	3,193,500	5,775,000	18,442,462,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,797,600	5,075,000	29,422,820,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,192,000	4,860,000	5,793,120,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,785,000	1,590,000	2,838,150,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	234,932	6,275,000	1,474,198,300.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,675,300	8,825,000	41,259,522,500.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	161,400	4,640,000	748,896,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,250,300	2,480,000	3,100,744,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	10,575,000	2,052,607,500.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,482,800	2,900,000	4,300,120,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	2,174,200	935,000	2,032,877,000.000	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	66,987,200	76,000	5,091,027,200.000		
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,045,082	2,260,000	2,361,885,320.000		
インドネシア・ルピア 小計	100,911,700		161,111,754,795.000 (1,562,784,022)		
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	47.300	616,413.600	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	48.150	279,270.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	10.630	241,301.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	21.520	127,828.800	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	66.680	200,040.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC	15,000	14.960	224,400.000	

MAGNETICS CO LTD				
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	7,140	16.030	114,454.200	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	9.080	108,960.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	44.810	232,115.800	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	12.730	155,306.000	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	14.360	251,300.000	
UNISPLENDOUR CORP LTD	7,040	20.980	147,699.200	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	11.640	122,220.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	12.080	230,728.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	69.810	83,772.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	16.550	268,110.000	
HUAGONG TECH CO LTD	2,200	29.970	65,934.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	160.430	336,903.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	27.700	326,860.000	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	14.200	126,380.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	28.750	232,875.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	13,600	17.470	237,592.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	19.260	267,714.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	12.530	299,467.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	7.000	220,500.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	3.670	226,806.000	
GEM CO LTD	29,100	5.930	172,563.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	80.650	209,690.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	24.030	165,807.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	5.990	348,019.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	13.490	227,981.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	5,900	89.060	525,454.000	

WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	7.900	123,184.700	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	23.460	138,507.840	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	16.410	95,374.920	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	8.130	240,648.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	22.860	305,409.600	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	18.280	120,648.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	24.800	126,480.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	44.660	415,338.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	23.400	243,360.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	32.080	32,080.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	37.410	897,840.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	14,350	63.180	906,633.000	
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	5,700	23.240	132,468.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	9.110	163,980.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	11.000	198,000.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	54.660	552,066.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	10.910	122,192.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	10.000	248,000.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	10.920	110,292.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	10.050	56,280.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	18.190	256,479.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	27.670	332,040.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	23.000	179,400.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	11.070	570,658.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	43.700	262,200.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	76.840	172,044.760	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	34.140	391,585.800	

GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	11.940	151,638.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.810	139,827.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	17.710	703,600.590	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	30.870	333,396.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	3,584	26.970	96,660.480	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	500	32.400	16,200.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	17.300	119,370.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	83,200	5.600	465,920.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	47.380	232,162.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	12.440	190,332.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	42.680	264,616.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	28.730	143,650.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	24.270	385,893.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	21.020	205,996.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,700	212.070	1,632,939.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	62.040	297,792.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	6.940	103,753.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	18.900	258,457.500	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	10.870	95,003.800	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	9,682	10.880	105,340.160	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	33.780	307,398.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	149.860	539,496.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.160	224,716.800	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	8.020	114,686.000	
LUXSHARE PRECISION	31,154	32.410	1,009,701.140	

INDUSTRY CO LTD				
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	16.870	504,413.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.720	157,300.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.900	491,970.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	10.020	199,398.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	21.140	403,774.000	
IFLYTEK CO LTD	14,700	47.400	696,780.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.170	202,678.000	
GOERTEK INC	25,100	19.390	486,689.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.060	150,378.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	24.840	874,368.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	34,900	13.770	480,573.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	129,320	4.100	530,212.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.770	163,291.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	3.730	140,248.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	15.860	642,139.680	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.750	153,225.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	25.710	316,233.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	50.580	532,101.600	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	15.430	1,202,274.740	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,800	119.250	930,150.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,700	156.900	2,934,030.000	
WANDA FILM HOLDING CO LTD	21,700	12.440	269,948.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	60,800	7.250	440,800.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.950	861,495.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	10.880	499,392.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	33.480	405,108.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.810	414,963.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	10.300	1,001,160.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	24,480	18.620	455,817.600	

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	133,800	4.530	606,114.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	11.890	655,139.000	
ZTE CORP	16,500	27.210	448,965.000	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.430	183,255.000	
WEICHAI POWER CO LTD	48,600	14.180	689,148.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	34.750	145,950.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	14.860	575,082.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	9.020	190,322.000	
BYD CO LTD	8,400	236.960	1,990,464.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	5.750	173,650.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	6.740	229,834.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	28.030	270,769.800	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	42.830	223,572.600	
LB GROUP CO LTD	11,000	17.710	194,810.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	10.510	449,828.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	14.250	119,700.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	39.500	82,950.000	
ASIA – POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	28.140	270,144.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	17.480	204,516.000	
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	6,400	27.760	177,664.000	
RISEN ENERGY CO LTD	1,100	18.380	20,218.000	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU CO LTD	15,200	13.850	210,520.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	16.940	135,520.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	16.370	207,899.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,200	256.010	563,222.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	6.590	198,359.000	
NANTONG FUJITSU	12,800	20.980	268,544.000	

MICROELECTRONICS CO LTD				
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	7.060	241,452.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	67,400	5.490	370,026.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	13.540	75,147.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	266.370	452,829.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.120	111,072.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	46.390	306,174.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	50.500	30,300.000	
NINESTAR CORP	1,100	26.070	28,677.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	5.860	223,852.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	9.190	233,609.800	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	59.640	95,424.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	15.350	259,415.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	26.070	278,949.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	148.400	270,088.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	76.080	136,944.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	5.940	89,694.000	
SF HOLDING CO LTD	24,400	40.150	979,660.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	6.310	148,916.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	44.960	179,840.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	76.570	191,425.000	
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	4,700	31.280	147,016.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	91,390	6.020	550,167.800	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	9.310	362,159.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	5.170	377,410.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	46.270	106,421.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	26.270	685,647.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	25.340	163,721.740	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	12.590	114,569.000	

HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	14.160	351,168.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	58.000	179,800.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.280	231,300.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46	25.400	1,168.400	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	7.160	277,808.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	24.000	88,800.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	6,760	15.700	106,132.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	15.560	237,725.680	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	95.230	209,506.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	33.780	148,969.800	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	68.200	252,340.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	44.500	120,150.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	33.960	105,276.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	87.200	183,120.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	36.810	335,559.960	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	12.480	118,560.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,100	101.540	314,774.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	11.550	118,965.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	59.100	5,910.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	32.250	222,525.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	74.210	336,913.400	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	117.880	353,640.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	50.080	65,104.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	25.840	124,032.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	29.100	90,210.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	31.000	99,200.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	8.120	103,124.000	

HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	57.330	137,592.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	12.080	257,304.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	10.540	139,128.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	100	74.420	7,442.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	68.530	130,207.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	36,700	8.140	298,738.000	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	23.910	282,138.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	42,300	15.410	651,843.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	285.210	1,654,218.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	60,800	4.120	250,496.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	8.070	125,085.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	86.850	138,960.000	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	4,050	53.700	217,485.000	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	15.220	129,370.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	25.280	102,636.800	
SG MICRO CORP	3,395	90.100	305,889.500	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	22,440	189.030	4,241,833.200	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	105.180	317,222.880	
WUXI APPTTEC CO LTD	13,972	88.190	1,232,190.680	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	51,400	7.590	390,126.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	27.680	285,104.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	84,000	4.010	336,840.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	3.720	306,900.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	51.190	373,687.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	143.430	367,180.800	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	25,300	14.290	361,537.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	34.760	258,093.000	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	960	78.970	75,811.200	
SHANGHAI FRIENDESS	1,100	234.600	258,060.000	

ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD				
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	65.350	71,885.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,655	37.480	211,949.400	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	49.000	123,480.000	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	170.010	510,030.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	56.600	305,640.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	4.620	246,708.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	44.260	119,502.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	27.570	226,074.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	109.600	551,288.000	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	3,325	38.020	126,416.500	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	14.530	185,984.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.510	286,893.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	3.480	246,036.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	21.830	233,581.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.440	209,312.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	75.450	165,990.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	44.870	130,123.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	142,600	4.920	701,592.000	
GONGNIU GROUP CO LTD	1,900	98.500	187,150.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	67.950	217,440.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	189.800	151,840.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	126.220	193,873.920	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	4.570	537,432.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	11.110	233,310.000	

SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	42.210	97,083.000	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	900	91.910	82,719.000	
HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	596	235.300	140,238.800	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	4,000	58.560	234,240.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	6.180	268,830.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	5,070	26.940	136,585.800	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	69.800	97,720.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	34.710	211,731.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	28.540	45,664.000	
SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD	7,600	20.530	156,028.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	41.130	246,780.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	47.950	137,137.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	23.710	274,372.120	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	7.360	262,016.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	7,077	49.750	352,080.750	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	67.200	194,880.000	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	5,320	18.800	100,016.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	126.140	327,964.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,900	38.900	307,310.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	39.400	181,240.000	
PIOTECH INC	592	250.360	148,213.120	
ASR MICROELECTRONICS CO LTD	4,000	67.830	271,320.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	10.020	402,804.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	136.990	383,572.000	
QI AN XIN TECHNOLOGY	5,600	47.310	264,936.000	

GROUP INC				
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	36.510	148,230.600	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,100	326.850	359,535.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	126.000	403,200.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	333.280	815,536.160	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	18.320	348,080.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	840	309.780	260,215.200	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	35.150	302,290.000	
HUNAN CHANGYUAN LICO CO LTD	22,400	8.540	191,296.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.170	402,752.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	16,800	18.240	306,432.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	7.080	830,484.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	4.780	1,461,246.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	3.630	1,499,553.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	3.950	774,200.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	173,000	5.410	935,930.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	30.900	426,420.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	31.100	1,054,290.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	98,300	30.160	2,964,728.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	52,800	42.350	2,236,080.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	106,900	14.980	1,601,362.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	159,500	6.880	1,097,360.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	230,400	3.810	877,824.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.600	620,500.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,300	1,775.840	11,187,792.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	194,300	5.820	1,130,826.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	22.460	1,340,862.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	38,700	24.140	934,218.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL	38,300	4.920	188,436.000	

PORT GROUP CO LTD				
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	120,200	22.570	2,712,914.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.120	588,112.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	2.950	679,385.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	228,800	5.070	1,160,016.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	9.960	552,780.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.560	393,092.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	27.520	814,592.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	66,400	4.470	296,808.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	124,800	4.450	555,360.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	133,600	6.050	808,280.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	23.530	545,896.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	14.280	589,764.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.610	448,990.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	28.090	328,653.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	11.100	618,270.000	
CRRC CORP LTD	141,700	5.240	742,508.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	33,352	48.390	1,613,903.280	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	21.190	368,706.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	16.300	656,890.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	5.810	497,336.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	32.000	211,200.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	22.320	573,624.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	14.170	682,994.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	3.730	377,849.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	6.410	360,242.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	28.380	351,912.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	7.600	200,640.000	
GEMDALE CORP	39,700	5.460	216,762.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	33,300	14.950	497,835.000	

WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	16,000	83.330	1,333,280.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.410	347,067.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	11.780	1,219,230.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	9.820	541,082.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	12.280	469,096.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	22.520	939,354.240	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.870	174,926.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	94.400	925,120.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	9.890	305,601.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.590	353,775.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	80.750	355,300.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.390	84,750.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	37,200	5.680	211,296.000	
AIR CHINA LTD	44,800	7.810	349,888.000	
TBEA CO LTD	24,180	14.100	340,938.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	6.910	300,585.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.220	180,964.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	5.130	534,546.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	25.500	540,600.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	37.090	385,736.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	29.370	202,653.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	17.580	261,942.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	4.220	144,746.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	17.180	99,644.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	9.390	236,628.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	8.890	293,370.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	14.460	342,702.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	18.190	207,366.000	

AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	36.110	335,823.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	7.690	440,637.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	15,853	7.480	118,580.440	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	48,070	9.700	466,279.000	
CMOC GROUP LIMITED	53,400	5.150	275,010.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	37,900	10.390	393,781.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	6.400	216,320.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	50.770	456,930.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	22.680	456,321.600	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	23.360	182,208.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	9.690	268,413.000	
PEOPLE. CN CO LTD	7,000	31.490	220,430.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	84,500	3.020	255,190.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.430	383,669.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	21,000	19.720	414,120.000	
YUTONG BUS CO LTD	23,900	12.480	298,272.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	5.840	250,536.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	4.170	331,515.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	15.160	227,688.040	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	4.950	287,100.000	
SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	20.130	155,001.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	32.600	334,606.400	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	17.130	278,362.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	17.330	57,189.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	88,000	5.980	526,240.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.540	149,860.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	36.410	371,382.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.370	177,093.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.680	171,008.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	37.460	172,316.000	
SOOCHOW SECURITIES CO	16,800	7.970	133,896.000	

LTD				
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	800	24.280	19,424.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	14,200	7.710	109,482.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	8.120	181,482.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	3.970	156,418.000	
HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD	15,100	23.920	361,192.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	5.810	113,876.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	12.200	284,260.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	249.730	624,325.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	6.800	231,880.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,380	244.300	1,558,634.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	10.710	134,946.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.210	352,728.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	6.360	159,000.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	1,250	35.600	44,500.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	14.720	298,816.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	2.950	86,140.000	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	14,400	29.750	428,400.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	8.850	282,315.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	14.420	181,692.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	14.150	369,315.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	34.390	144,438.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.490	258,068.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	7.920	375,883.200	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	16.660	211,582.000	
ZHEJIANG HUAHAI	5,830	15.830	92,288.900	

PHARMACEUTICAL CO LTD				
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	10.800	210,600.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.090	142,662.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	9.720	217,728.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	20,900	17.590	367,631.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	27.250	463,250.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	10,654	43.550	463,981.700	
JCET GROUP CO LTD	10,900	31.520	343,568.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	26.530	180,404.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	73.900	184,750.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	32.280	171,084.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	30.750	322,567.500	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	101.070	171,819.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	11.640	235,663.440	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	2.370	147,888.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	14.120	186,384.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,924	57.590	225,983.160	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	8.110	158,956.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	13.140	257,544.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	10.930	215,321.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	13.590	213,363.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	2,210	67.520	149,219.200	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	35.020	171,598.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	19.790	110,824.000	
SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	110.780	232,638.000	
BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	16.070	237,836.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	48.930	205,506.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,500	54.700	82,050.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	77.540	69,786.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	1,540	73.940	113,867.600	

HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	35.000	91,000.000	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	1,000	181.990	181,990.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	77.460	123,936.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	121.000	169,400.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	52.080	369,768.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	31.020	344,322.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.730	718,014.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	23.280	270,048.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	67,300	5.780	388,994.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	113.990	113,990.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	840	214.750	180,390.000	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	1,600	147.580	236,128.000	
3PEAK INC	1,200	165.560	198,672.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	160	43.620	6,979.200	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	43,468	23.530	1,022,802.040	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	14.840	188,468.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	143.500	258,300.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	4.480	328,384.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	27.430	279,786.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	40,151	18.500	742,793.500	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	27,119	38.360	1,040,284.840	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	4,400	55.050	242,220.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	29.380	205,660.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.530	112,596.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	69.800	488,600.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	1,000	13.590	13,590.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	15.090	614,163.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	7.260	762,300.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY	3,400	48.250	164,050.000	

CO LTD				
SERES GROUP CO LTD	9,000	81.680	735,120.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	73.040	387,112.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,800	57.480	160,944.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	6.760	562,432.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	12,200	10.580	129,076.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	19.030	216,942.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	46.980	65,772.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	17.510	35,020.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	4,100	13.610	55,801.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	950	39.050	37,097.500	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	13.000	395,200.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	7.070	299,061.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	89.380	286,016.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	16.670	306,728.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,012	26.160	104,953.920	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,004	37.880	151,671.520	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	500	293.800	146,900.000	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	48.750	143,325.000	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	18.110	204,824.100	
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	8.940	440,742.000	
SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	53.230	351,318.000	
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	16.950	271,200.000	
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	38.600	173,700.000	
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	103,500	2.550	263,925.000	
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	12.250	131,075.000	
オフショア・人民元 小計	14,239,587		188,939,878.040 (3,921,692,791)	
カタール・リアル				
QATAR NATIONAL BANK	390,750	15.890	6,209,017.500	
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	257,559	5.217	1,343,685.300	
OOREDOO QSC	60,920	9.891	602,559.720	
QATAR FUEL QSC	55,285	16.330	902,804.050	

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,416	17.000	636,072.000	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	89,109	9.806	873,802.850	
	INDUSTRIES QATAR QSC	122,724	12.910	1,584,366.840	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	141,948	18.050	2,562,161.400	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	190,107	3.438	653,587.860	
	MASRAF AL RAYAN	513,711	2.360	1,212,357.960	
	BARWA REAL ESTATE CO	220,226	2.670	588,003.420	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	382,470	1.598	611,187.060	
	DUKHAN BANK	131,518	3.886	511,078.940	
カタール・リアル 小計		2,593,743		18,290,684.900 (762,172,840)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	678,487	0.698	473,583.920	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	152,316	0.482	73,416.310	
	GULF BANK KSCP	146,991	0.241	35,424.830	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	637,389	0.888	566,001.430	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	147,215	0.525	77,287.870	
	MABANEE CO KPSC	63,803	0.818	52,190.850	
	BOUBYAN BANK KSCP	126,901	0.602	76,394.400	
クウェート・ディナール 小計		1,953,102		1,354,299.610 (666,220,607)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	39,057	14,940.000	583,511,580.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	30,700.000	615,504,300.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	37,131	27,280.000	1,012,933,680.000	
コロンビア・ペソ 小計		96,237		2,211,949,560.000 (83,114,005)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	25,515	37.700	961,915.500	
	JARIR MARKETING CO	45,430	14.300	649,649.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	5,690	116.600	663,454.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	33,646	47.900	1,611,643.400	
	SAUDI BRITISH BANK	86,878	34.500	2,997,291.000	
	AL RAJHI BANK	165,180	70.700	11,678,226.000	
	ARAB NATIONAL BANK	59,709	23.920	1,428,239.280	
	BANK ALBILAD	39,341	36.600	1,439,880.600	
	BANK AL-JAZIRA	29,917	16.620	497,220.540	
	BANQUE SAUDI FRANSI	51,955	36.850	1,914,541.750	
	RIYAD BANK	126,057	27.200	3,428,750.400	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,345	14.860	614,386.700	

SAUDI TELECOM CO	170,289	37.700	6,419,895.300	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	19,849	134.800	2,675,645.200	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	75,957	77.700	5,901,858.900	
SAUDI ELECTRICITY CO	67,449	18.340	1,237,014.660	
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	22.520	627,114.440	
SAVOLA GROUP	24,293	37.500	910,987.500	
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	35,693	11.880	424,032.840	
ALMARAI CO JSC	19,978	54.200	1,082,807.600	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,024	149.600	452,390.400	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	31,604	32.800	1,036,611.200	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	37.450	380,641.800	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	68,827	10.680	735,072.360	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	46,657	14.660	683,991.620	
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	29,849	9.610	286,848.890	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	14.140	509,874.260	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,017	201.000	1,209,417.000	
ALINMA BANK	84,064	34.750	2,921,224.000	
SAUDI ARABIAN MINING CO	110,435	37.250	4,113,703.750	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	8,917	106.200	946,985.400	
DALLAH HEALTHCARE CO	2,553	157.000	400,821.000	
SAUDI ARABIAN OIL CO	224,881	33.550	7,544,757.550	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	7,189	260.800	1,874,891.200	
ACWA POWER CO	7,732	211.600	1,636,091.200	
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	134.000	533,454.000	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,248	311.600	700,476.800	
NAHDI MEDICAL CO	3,277	131.200	429,942.400	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,500	169.200	592,200.000	
ELM CO	1,951	707.800	1,380,917.800	
POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	54.300	360,280.500	
THE SAUDI NATIONAL BANK	249,122	34.800	8,669,445.600	
サウジアラビア・リアル 小計	2,100,704		84,564,593.340 (3,425,711,676)	

タイ・パーツ

BERLI JUCKER PCL NVDR	94,700	27.750	2,627,925.000	
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	18.800	5,696,400.000	
CP AXTRA PCL NVDR	159,300	27.000	4,301,100.000	
RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	88,300	32.000	2,825,600.000	
KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	131.500	5,970,100.000	
TMBTHANACHART BANK PCL- NVDR	2,317,300	1.590	3,684,507.000	
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	650,500	7.700	5,008,850.000	
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	18,500	126.500	2,340,250.000	
SHIN CORP PCL	70,700	70.500	4,984,350.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	18.100	5,430,000.000	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	101,100	222.000	22,444,200.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	548,420	12.100	6,635,882.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	267,600	77.750	20,805,900.000	
PTT PCL	842,600	33.000	27,805,800.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	45.750	3,682,875.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	656,100	7.550	4,953,555.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	63,750	290.000	18,487,500.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	357,600	67.500	24,138,000.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	177,700	64.750	11,506,075.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	954,100	26.750	25,522,175.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	48,200	230.000	11,086,000.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	296,710	27.750	8,233,702.500	
THAI OIL PCL NVDR	122,400	47.250	5,783,400.000	
CP ALL PCL NVDR	498,700	55.750	27,802,525.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	643,100	7.300	4,694,630.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	113,645	161.500	18,353,667.500	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	135,122	25.000	3,378,050.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	216,208	36.000	7,783,488.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	142,900	44.250	6,323,325.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	7.900	4,976,210.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	51,900	23.600	1,224,840.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	238,100	44.750	10,654,975.000	
OSOTSPA PCL NVDR	90,600	23.700	2,147,220.000	

	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	950,200	3.640	3,458,728.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	157,833	38.250	6,037,112.250	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	97,800	36.250	3,545,250.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	277,100	18.200	5,043,220.000	
	SCB X PCL NVDR	67,700	97.500	6,600,750.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	896,328	5.750	5,153,886.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	58,700	41.500	2,436,050.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	76,900	43.750	3,364,375.000	
タイ・パーツ 小計		13,907,216		356,932,448.250 (1,506,254,932)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	668.000	3,928,508.000	
	CEZ	13,897	979.500	13,612,111.500	
	MONETA MONEY BANK AS	33,423	90.800	3,034,808.400	
チェコ・コルナ 小計		53,201		20,575,427.900 (135,697,005)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	41.100	217,000,108.800	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	6,880	23,314.000	160,400,320.000	
	BANCO DE CHILE	3,730,618	94.250	351,610,746.500	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,718.000	145,861,636.000	
	EMPRESAS COPEC SA	35,539	6,381.000	226,774,359.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,442	5,392.600	56,309,529.200	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,173,923	49.820	58,484,843.860	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	95.700	161,107,217.700	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	12,221	42,601.000	520,626,821.000	
	FALABELLA SA	78,482	1,892.100	148,495,792.200	
	CENCOSUD SA	115,184	1,535.000	176,807,440.000	
	ENEL CHILE SA	2,550,215	54.000	137,711,610.000	
チリ・ペソ 小計		14,761,675		2,361,190,424.260 (392,052,058)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	282,178	28.980	8,177,518.440	
	AELSAN ELEKTRONIK SANAYI	132,576	42.160	5,589,404.160	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	107,671	38.260	4,119,492.460	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	823.000	4,683,693.000	
	HEKTAS TICARET TAS	78,592	21.840	1,716,449.280	
	KOC HOLDING AS	60,321	140.500	8,475,100.500	
	SASA POLYESTER SANAYI	84,709	44.000	3,727,196.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	132,539	48.440	6,420,189.160	
	TOFAS TURK OTOMOBIL	9,553	259.500	2,479,003.500	

	FABRIKASI AS				
	TURK HAVA YOLLARI	44,287	229.100	10,146,151.700	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	104,797	55.000	5,763,835.000	
	TURKIYE IS BANKASI	262,880	20.080	5,278,630.400	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	86,284	149.800	12,925,343.200	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	315,938	16.940	5,351,989.720	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	82,771	57.050	4,722,085.550	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	40,436	293.750	11,878,075.000	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	78,429	22.120	1,734,849.480	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	3,431	723.000	2,480,613.000	
トルコ・リラ 小計		1,913,083		105,669,619.550 (562,489,952)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	11,459	8,940.000	102,443,460.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	36,818	2,844.000	104,710,392.000	
	OTP BANK NYRT	20,436	13,945.000	284,980,020.000	
ハンガリー・フォリント 小計		68,713		492,133,872.000 (211,475,830)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	614,100	28.950	17,778,195.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	161,790	48.900	7,911,531.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	176,968	104.100	18,422,368.800	
	AYALA CORP	22,473	627.000	14,090,571.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	79,760	208.600	16,637,936.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	229,760	38.100	8,753,856.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	34,240	216.400	7,409,536.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	175,645	52.400	9,203,798.000	
	BDO UNIBANK INC	189,402	133.800	25,341,987.600	
	PLDT INC	5,690	1,245.000	7,084,050.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	820,375	31.400	25,759,775.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	113.000	8,525,850.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	821.000	15,913,443.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	365.000	8,913,300.000	
フィリピン・ペソ 小計		2,629,456		191,746,197.400 (519,766,417)	
ブラジル・リアル	VALE SA	289,089	71.550	20,684,317.950	
	RAIA DROGASIL SA	104,664	26.750	2,799,762.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	41.270	843,971.500	

CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	104,900	37.350	3,918,015.000
BANCO DO BRASIL SA	73,600	50.240	3,697,664.000
ITAUSA SA	439,626	9.440	4,150,069.440
GERDAU SA	93,181	23.760	2,213,980.560
PETROLEO BRASILEIRO SA	318,110	37.420	11,903,676.200
VIBRA ENERGIA SA	104,100	21.370	2,224,617.000
PETROLEO BRASILEIRO SA	400,612	34.720	13,909,248.640
CCR SA	92,520	12.500	1,156,500.000
WEG SA	143,344	33.170	4,754,720.480
BANCO BRADESCO SA PREF	458,202	15.040	6,891,358.080
BANCO BRADESCO SA	126,592	13.310	1,684,939.520
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	12.670	610,770.020
SUZANO SA	67,875	54.640	3,708,690.000
CPFL ENERGIA SA	16,900	35.660	602,654.000
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	408,547	29.590	12,088,905.730
ENGIE BRASIL SA	15,287	41.790	638,843.730
LOCALIZA RENT A CAR	78,089	56.680	4,426,084.520
LOJAS RENNER SA	91,520	12.960	1,186,099.200
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	66,004	23.420	1,545,813.680
COSAN SA	98,200	17.740	1,742,068.000
TOTVS SA	44,400	31.800	1,411,920.000
EQUATORIAL ENERGIA SA	87,300	33.720	2,943,756.000
JBS SA	68,600	21.310	1,461,866.000
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	109,262	12.860	1,405,109.320
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,198	61.130	1,662,613.740
ENEVA SA	82,200	11.840	973,248.000
HYPERA SA	29,800	32.550	969,990.000
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	494,848	12.960	6,413,230.080
MAGAZINE LUIZA SA	239,400	1.800	430,920.000
PRIO SA	68,200	46.470	3,169,254.000
TELEFONICA BRASIL SA	33,228	50.100	1,664,722.800
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,100	31.300	1,818,530.000
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	427,361	4.400	1,880,388.400
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	54,800	10.540	577,592.000
AMBEV SA	400,595	13.350	5,347,943.250
NATURA &CO HOLDING SA	68,800	13.940	959,072.000
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	121,700	12.610	1,534,637.000
TIM SA	77,200	17.340	1,338,648.000
REDE D'OR SAO LUIZ SA	46,300	24.630	1,140,369.000
RUMO SA	105,100	23.090	2,426,759.000

ブラジル・リアル 小計		6,304,010		146,913,337.840 (4,536,742,638)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	523.400	703,449.600	
	BUDIMEX SA	1,092	475.000	518,700.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,918	105.900	1,156,216.200	
	BANK PEKAO SA	14,797	129.500	1,916,211.500	
	ORLEN SA	49,555	62.160	3,080,338.800	
	LPP SA	92	13,950.000	1,283,400.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,165	465.800	1,474,257.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,671	109.200	510,073.200	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	75,167	43.800	3,292,314.600	
	CYFROWY POLSAT SA	29,883	11.800	352,619.400	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	79,636	7.000	557,452.000	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	52,196	45.750	2,387,967.000	
	DINO POLSKA SA	3,987	434.400	1,731,952.800	
	ALLEGRO. EU SA	38,700	30.885	1,195,249.500	
	PEPCO GROUP NV	16,587	18.200	301,883.400	
ポーランド・ズロチ 小計		381,790		20,462,085.000 (748,744,522)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	168,600	3.870	652,482.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	550,000	5.750	3,162,500.000	
	CELCOMDIGI BHD	272,700	4.250	1,158,975.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	88,120	7.330	645,919.600	
	RHB BANK BHD	103,780	5.640	585,319.200	
	GAMUDA BHD	156,100	4.590	716,499.000	
	GENTING BHD	164,900	4.150	684,335.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	14,956	17.140	256,345.840	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	19.080	935,072.640	
	IOI CORP BHD	223,013	3.940	878,671.220	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,500	21.680	943,080.000	
	MALAYAN BANKING BHD	444,275	9.080	4,034,017.000	
	MISC BHD	102,180	7.200	735,696.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,200	121.700	754,540.000	
	PPB GROUP BHD	55,660	14.420	802,617.200	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	22.700	519,830.000	
	PETRONAS GAS BHD	61,000	16.920	1,032,120.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.460	590,646.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	5.220	497,466.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	213,550	9.920	2,118,416.000	
	QL RESOURCES BHD	102,850	5.600	575,960.000	
	DIALOG GROUP BHD	292,144	2.100	613,502.400	
PUBLIC BANK BHD (LOCAL)	1,228,050	4.160	5,108,688.000		

	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.340	548,496.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	239,500	2.400	574,800.000	
	MAXIS BHD	228,300	4.030	920,049.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	2.920	647,948.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	249,300	7.190	1,792,467.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	192,300	5.890	1,132,647.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	332,000	4.840	1,606,880.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	161,500	4.330	699,295.000	
	MR DIY GROUP M BHD	245,100	1.560	382,356.000	
マレーシア・リングgit 小計		6,803,186		36,307,636.100 (1,169,283,790)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	262,900	11.200	2,944,480.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	114,100	80.480	9,182,768.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,360	320.770	5,247,797.200	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	18,660	163.640	3,053,522.400	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	44,800	125.260	5,611,648.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	220,000	157.470	34,643,400.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	87,025	31.250	2,719,531.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,495	219.040	3,394,024.800	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	34.010	4,135,616.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	15,465	384.570	5,947,375.050	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	267,952	73.340	19,651,599.680	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	158,000	39.190	6,192,020.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,800	176.120	7,537,936.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	444,100	66.970	29,741,377.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	34,795	223.840	7,788,512.800	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	18.300	1,903,200.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,598,278	15.230	24,341,773.940	
	BANCO DEL BAJIO SA	69,500	55.590	3,863,505.000	
	メキシコ・ペソ 小計		3,635,830		177,900,087.120 (1,528,997,879)
ユーロ	PIRAEUS BANK S. A	54,745	2.748	150,439.260	
	ALPHA BANK A. E.	206,387	1.395	287,909.860	
	NATIONAL BANK OF GREECE	45,590	5.440	248,009.600	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,083	12.650	203,449.950	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	

	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	229,050	1.495	342,429.750	
	MYTILINEOS HOLDINGS	8,855	34.740	307,622.700	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,506	21.700	119,480.200	
	OPAP SA	16,204	15.390	249,379.560	
	JUMBO SA	9,500	25.980	246,810.000	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	10.020	169,087.500	
ユーロ 小計		611,925		2,324,618.380 (376,750,901)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	84,300.000	144,996,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	102,400.000	299,827,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,478	250,000.000	619,500,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,241	84,600.000	358,788,600.000	
	COWAY CO LTD	5,351	51,800.000	277,181,800.000	
	KT&G CORP	8,884	89,600.000	796,006,400.000	
	KAKAO CORP	26,762	45,650.000	1,221,685,300.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	4,022	23,700.000	95,321,400.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	23,496	7,350.000	172,695,600.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,298	261,000.000	338,778,000.000	
	LG UPLUS CORP	17,131	10,300.000	176,449,300.000	
	DOOSAN ENERBILITY	36,105	13,840.000	499,693,200.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	56,400.000	238,290,000.000	
	LG H&H CO LTD	891	332,500.000	296,257,500.000	
	LG CHEM LTD	4,231	457,500.000	1,935,682,500.000	
	LG CHEM LTD	599	290,000.000	173,710,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	37,670	35,300.000	1,329,751,000.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	22,407	16,550.000	370,835,850.000	
	S-OIL CORP	4,206	66,900.000	281,381,400.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	9,175	30,450.000	279,378,750.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,664	37,900.000	214,665,600.000	
	POSCO FUTURE M CO LTD	2,691	277,000.000	745,407,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,749	144,100.000	252,030,900.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	2,521	65,300.000	164,621,300.000	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,314	97,100.000	321,789,400.000	
	HYUNDAI MOBIS	5,222	223,000.000	1,164,506,000.000	
	SK HYNIX INC	46,198	130,500.000	6,028,839,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,695	35,100.000	199,894,500.000		
HYUNDAI MOTOR CO	1,864	101,700.000	189,568,800.000		
HYUNDAI MOTOR CO	11,733	173,700.000	2,038,022,100.000		

HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,036	74,500.000	151,682,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,149	34,250.000	244,853,250.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	11,470.000	249,873,950.000	
KIA CORPORATION	22,149	77,000.000	1,705,473,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	760	479,500.000	364,420,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	23,024	16,950.000	390,256,800.000	
KOREAN AIR CO LTD	17,342	21,300.000	369,384,600.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	129,000.000	155,961,000.000	
KT CORP	5,536	32,900.000	182,134,400.000	
HLB INC	8,598	30,400.000	261,379,200.000	
LG ELECTRONICS INC	9,125	103,700.000	946,262,500.000	
LG CORP	8,184	81,300.000	665,359,200.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,234	10,160.000	93,817,440.000	
NAVER CORP	11,161	194,700.000	2,173,046,700.000	
L&F CO LTD	2,034	145,800.000	296,557,200.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	56,900.000	195,906,700.000	
KANGWON LAND INC	9,245	15,210.000	140,616,450.000	
POSCO HOLDINGS INC	6,124	447,500.000	2,740,490,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12,226	24,650.000	301,370,900.000	
COSMOAM&T CO LTD	2,095	150,900.000	316,135,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,679	420,000.000	1,965,180,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	4,862	134,400.000	653,452,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	403,642	70,500.000	28,456,761,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	58,658	7,150.000	419,404,700.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,128	124,800.000	390,374,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	68,941	56,700.000	3,908,954,700.000	
YUHAN CORP	4,477	62,000.000	277,574,000.000	
HANON SYSTEMS	13,064	7,010.000	91,578,640.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	42,150.000	160,296,450.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,254	13,290.000	242,595,660.000	
CELLTRION INC	9,362	157,200.000	1,471,706,400.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,934	66,300.000	260,824,200.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,504	40,800.000	1,040,563,200.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,673	173,400.000	290,098,200.000	
CELLTRION PHARM INC	1,764	70,400.000	124,185,600.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,524	69,700.000	454,722,800.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,280	138,200.000	315,096,000.000	
JYP ENTERTAINMENT CORP	2,605	103,400.000	269,357,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,838	131,300.000	635,229,400.000	
ECOPRO CO LTD	1,709	685,000.000	1,170,665,000.000	

	CJ CHEILJEDANG CORP	713	304,500.000	217,108,500.000	
	STX PAN OCEAN CO LTD	16,660	4,525.000	75,386,500.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,252	241,500.000	302,358,000.000	
	SK INC	3,291	159,600.000	525,243,600.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	32,608	53,500.000	1,744,528,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,645	46,300.000	261,363,500.000	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,508	40,200.000	100,821,600.000	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,375	52,900.000	443,037,500.000	
	HANMI PHARM CO LTD	574	295,000.000	169,330,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	43,000.000	237,833,000.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	3,720	59,100.000	219,852,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	715	145,300.000	103,889,500.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	124,300.000	250,215,900.000	
	NETMARBLE CORP	1,319	47,000.000	61,993,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	49,019	12,320.000	603,914,080.000	
	ECOPRO BM CO LTD	4,214	233,000.000	981,862,000.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,801	87,600.000	245,367,600.000	
	KRAFTON INC	2,300	192,900.000	443,670,000.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,996	111,400.000	222,354,400.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,878	64,700.000	121,506,600.000	
	SK SQUARE CO LTD	8,852	48,250.000	427,109,000.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	65,300.000	152,802,000.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	26,000.000	84,864,000.000	
	HYBE CO LTD	1,493	212,000.000	316,516,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,972	411,000.000	1,632,492,000.000	
	KAKAOBANK CORP	13,292	22,950.000	305,051,400.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,268	92,000.000	116,656,000.000	
	KAKAOPAY CORP	2,237	40,650.000	90,934,050.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,481	144,100.000	501,612,100.000	
	SAMSUNG C&T CORP	7,009	114,900.000	805,334,100.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,510	726,000.000	1,096,260,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,320	43,550.000	101,036,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,542	40,350.000	183,269,700.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,659	69,800.000	604,398,200.000	
	韓国・ウォン 小計	1,342,002		89,519,125,170.000 (10,303,651,307)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	10.680	939,840.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	6.820	695,640.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	160,000	3.690	590,400.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY	8,700	127.180	1,106,466.000	

CO LTD				
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	109,000	18.600	2,027,400.000	
BEIJING ENTERPRISES	42,500	25.650	1,090,125.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	350,000	3.750	1,312,500.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	482,000	4.720	2,275,040.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	181,000	13.560	2,454,360.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	54,000	25.750	1,390,500.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	765,600	6.830	5,229,048.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	337,620	14.380	4,854,975.600	
CHINA RESOURCES LAND LTD	276,888	28.250	7,822,086.000	
CITIC LTD	469,000	6.650	3,118,850.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	226,000	3.170	716,420.000	
LENOVO GROUP LTD	626,000	9.050	5,665,300.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,786,000	4.940	8,822,840.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	7.130	829,860.700	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,101,200	3.980	8,362,776.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	12.480	923,520.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	221,000	11.540	2,550,340.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	63,500	57.700	3,663,950.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	340,000	6.860	2,332,400.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	94,000	4.710	442,740.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	162,200	7.050	1,143,510.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	120,000	9.880	1,185,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	3.950	1,224,500.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	101,000	5.790	584,790.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	249,600	7.160	1,787,136.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	54,500	18.380	1,001,710.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	491,000	9.270	4,551,570.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	83,200	23.450	1,951,040.000	
BYD CO LTD	88,500	241.200	21,346,200.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	8.850	1,416,000.000	
CHINA EVERBRIGHT	284,592	2.640	751,322.880	

ENVIRONMENT GROUP				
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	218,000	5.860	1,277,480.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	93.600	936,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	591,788	9.270	5,485,874.760	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.490	764,310.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	153,200	15.300	2,343,960.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	11.140	2,116,600.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	633,000	10.300	6,519,900.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	463,000	11.500	5,324,500.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	231,600	7.680	1,778,688.000	
WEICHAI POWER CO LTD	152,440	12.940	1,972,573.600	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	8.150	929,100.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	10.040	1,807,200.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	52,000	56.650	2,945,800.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	262,000	5.490	1,438,380.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	220,000	3.560	783,200.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	139,333	39.750	5,538,486.750	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	86,000	5.590	480,740.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	913,250	3.440	3,141,580.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	271,000	24.050	6,517,550.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	566,800	302.800	171,627,040.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	569,000	37.150	21,138,350.000	
LI NING CO LTD	206,000	24.650	5,077,900.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	456,000	1.630	743,280.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	438,000	2.980	1,305,240.000	
AIR CHINA / HONG KONG	156,000	5.090	794,040.000	
ZTE CORP	63,288	18.180	1,150,575.840	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	285,500	24.400	6,966,200.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,250	7.780	1,931,385.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	767,205	4.530	3,475,438.650	
CHINA STATE CONSTRUCTION	180,250	8.480	1,528,520.000	

INT HOLDINGS LTD				
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	64,500	17.260	1,113,270.000	
BAIDU INC	191,500	101.300	19,398,950.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,117,530	4.410	35,798,307.300	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	71,300	81.200	5,789,560.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	202,000	3.480	702,960.000	
MINTH GROUP LTD	66,000	17.700	1,168,200.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	4.360	706,320.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	342,000	3.620	1,238,040.000	
BANK OF CHINA LTD	6,649,200	2.770	18,418,284.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	77,500	7.720	598,300.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	336,970	29.200	9,839,524.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,507,235	3.680	20,266,624.800	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	95,000	9.170	871,150.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	95,500	7.330	700,015.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	147,600	3.210	473,796.000	
CHINA COAL ENERGY CO	140,000	6.110	855,400.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	18.840	1,036,200.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,600	25.000	940,000.000	
CMOC GROUP LIMITED	315,000	4.210	1,326,150.000	
CHINA CITIC BANK-H	724,800	3.450	2,500,560.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	61,700	68.200	4,207,940.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	109,000	90.300	9,842,700.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	18.780	657,300.000	
FOSUN INTERNATIONAL	212,528	4.730	1,005,257.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	0.930	518,940.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	316,000	3.090	976,440.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,200	29.350	2,236,470.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,582,000	1.160	1,835,120.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	62,500	14.480	905,000.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	351,000	3.540	1,242,540.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	141,000	5.320	750,120.000	

DONGYUE GROUP	111,000	5.860	650,460.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	63,500	34.900	2,216,150.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	425,000	4.590	1,950,750.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	223,000	16.720	3,728,560.000	
CRRC CORP LTD - H	385,000	3.180	1,224,300.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	121,500	6.860	833,490.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	118,000	13.060	1,541,080.000	
SINOPHARM GROUP CO	121,600	19.140	2,327,424.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	172,000	1.950	335,400.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	214,527	3.590	770,151.930	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	204,000	7.060	1,440,240.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	289,000	6.350	1,835,150.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	70,400	11.480	808,192.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	178,800	11.200	2,002,560.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	97,000	9.200	892,400.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	155,000	11.880	1,841,400.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	69,000	16.460	1,135,740.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	531,656	2.560	1,361,039.360	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.200	499,400.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,473,000	2.790	6,899,670.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	73,000	18.700	1,365,100.000	
FAR EAST HORIZON LTD	120,000	5.550	666,000.000	
MICROPORIT SCIENTIFIC CORP	61,200	13.100	801,720.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	146,000	16.180	2,362,280.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	239,600	4.560	1,092,576.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	672,000	2.510	1,686,720.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	17.940	825,240.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	287,500	4.250	1,221,875.000	

HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	667,000	3.560	2,374,520.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	37,000	14.660	542,420.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	102,000	23.200	2,366,400.000	
EAST BUY HOLDING LTD	32,500	29.600	962,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	175,000	6.940	1,214,500.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	41,400	18.400	761,760.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	14.520	929,280.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,522,000	0.780	2,747,160.000	
XIAOMI CORP	1,301,600	16.040	20,877,664.000	
BEIGENE LTD	59,400	117.000	6,949,800.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	30,612	94.600	2,895,895.200	
MEITUAN	429,610	110.700	47,557,827.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	112,400	14.120	1,587,088.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	16.640	2,263,040.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	4.520	1,744,720.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	99,500	46.700	4,646,650.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,059,000	0.770	815,430.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	48,000	4.930	236,640.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	154,500	6.500	1,004,250.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	133,000	6.470	860,510.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	88,000	14.220	1,251,360.000	
CHINA FEIHE LTD	336,000	4.840	1,626,240.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,388,968	79.600	110,561,852.800	
JD.COM INC	199,935	99.000	19,793,565.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	140,000	6.360	890,400.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	89.350	679,060.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	84,000	8.680	729,120.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	198,200	54.600	10,821,720.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	213,200	22.300	4,754,360.000	
BILIBILI INC	15,640	109.300	1,709,452.000	
AKESO INC	40,000	47.950	1,918,000.000	

NETEASE INC	164,400	175.200	28,802,880.000		
GDS HOLDINGS LTD	90,500	10.460	946,630.000		
ZAI LAB LTD	70,500	21.800	1,536,900.000		
NONGFU SPRING CO LTD	149,200	43.900	6,549,880.000		
LI AUTO INC	95,700	144.900	13,866,930.000		
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	97,750	37.700	3,685,175.000		
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	30,400	48.050	1,460,720.000		
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	64,800	29.250	1,895,400.000		
CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	7.820	1,275,919.020		
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	129,200	52.500	6,783,000.000		
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	35,600	22.600	804,560.000		
JD LOGISTICS INC	182,600	9.230	1,685,398.000		
TRIP.COM GROUP LTD	46,800	260.600	12,196,080.000		
XPENG INC	89,200	60.650	5,409,980.000		
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	42,000	16.960	712,320.000		
CGN POWER CO LTD	826,000	1.860	1,536,360.000		
GF SECURITIES CO LTD	83,200	9.960	828,672.000		
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	34.200	1,655,280.000		
HUATAI SECURITIES CO LTD	115,800	11.020	1,276,116.000		
3SBIO INC	127,500	7.010	893,775.000		
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	95,500	4.790	457,445.000		
CHINA LITERATURE LTD	38,600	28.700	1,107,820.000		
FLAT GLASS GROUP CO LTD	25,000	14.740	368,500.000		
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	100,000	6.710	671,000.000		
BOC AVIATION LTD	18,100	52.100	943,010.000		
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	61,200	21.100	1,291,320.000		
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	14.160	1,387,680.000		
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	13.140	1,613,592.000		
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	325,000	48.850	15,876,250.000		
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	1.830	951,600.000		
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,040	27.950	923,468.000		
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	16.500	990,000.000		
香港・ドル 小計	71,774,356		944,691,499.630 (18,345,908,919)		
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	43,806	545.000	23,874,270.000	

ACER INC	269,770	34.150	9,212,645.500	
ASUSTEK COMPUTER INC	61,226	355.500	21,765,843.000	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	42,575	407.500	17,349,312.500	
ASIA CEMENT CORP	203,290	40.350	8,202,751.500	
TAIWAN BUSINESS BANK	556,935	13.000	7,240,155.000	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	79,495	68.100	5,413,609.500	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	41,042	230.500	9,460,181.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	64,792	174.500	11,306,204.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	118,146	151.000	17,840,046.000	
QUANTA COMPUTER INC	231,584	213.500	49,443,184.000	
EVA AIRWAYS CORP	191,977	29.700	5,701,716.900	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	44,975	187.500	8,432,812.500	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	469,004	17.350	8,137,219.400	
CHINA AIRLINES	231,823	20.800	4,821,918.400	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	182,099	44.800	8,158,035.200	
CHINA STEEL CORP	1,024,897	24.650	25,263,711.050	
ADVANTECH CO LTD	37,817	340.000	12,857,780.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	382,807	29.750	11,388,508.250	
DELTA ELECTRONICS INC	164,999	303.500	50,077,196.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	112,226	63.700	7,148,796.200	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	317,092	117.000	37,099,764.000	
AUO CORP	526,500	15.800	8,318,700.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	139,574	97.900	13,664,294.600	
EVERGREEN MARINE CORP	90,543	109.000	9,869,187.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	225,768	30.250	6,829,482.000	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	184.000	7,384,104.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,999	583.000	9,327,417.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	49,893	481.500	24,023,479.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	320,807	77.700	24,926,703.900	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	301,868	62.600	18,896,936.800	
GIANT MANUFACTURING	24,172	168.500	4,072,982.000	
MEDIATEK INC	128,747	884.000	113,812,348.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	657,575	61.500	40,440,862.500	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	759,944	20.900	15,882,829.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	24,801	636.000	15,773,436.000	
FAR EASTONE	143,586	78.500	11,271,501.000	

TELECOMMUNICATIONS CO LTD				
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	860,961	25.000	21,524,025.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	811,517	44.950	36,477,689.150	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,307,205	11.450	14,967,497.250	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,194,466	24.500	29,264,417.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,050,367	97.200	102,095,672.400	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	961,752	38.400	36,931,276.800	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,131	2,095.000	17,034,445.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	900,807	17.700	15,944,283.900	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,048,098	8.920	9,349,034.160	
INVENTEC CO LTD	216,699	42.500	9,209,707.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	176,046	112.500	19,805,175.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	842,432	18.450	15,542,870.400	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,499,554	25.500	38,238,627.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	923,981	26.850	24,808,889.850	
NAN YA PLASTICS CORP	403,189	64.900	26,166,966.100	
WISTRON CORP	226,278	98.100	22,197,871.800	
POU CHEN CORP	168,225	29.450	4,954,226.250	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	408,936	69.800	28,543,732.800	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,363	266.000	12,332,558.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	87,341	80.300	7,013,482.300	
E INK HOLDINGS INC	69,588	173.500	12,073,518.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	34.150	4,149,805.550	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	112,538	68.900	7,753,868.200	
TAIWAN CEMENT CORP	552,189	32.850	18,139,408.650	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,081,866	557.000	1,159,599,362.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	953,411	48.550	46,288,104.050	
WAN HAI LINES LTD	51,482	45.000	2,316,690.000	
WALSIN LIHWA CORP	237,342	35.450	8,413,773.900	
WINBOND ELECTRONICS CORP	287,521	25.000	7,188,025.000	
YAGEO CORP	29,149	545.000	15,886,205.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	152,894	41.300	6,314,522.200	

	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	29.900	4,349,403.500	
	GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,670.000	11,529,680.000	
	INNOLUX CORPORATION	691,396	12.100	8,365,891.600	
	WPG HOLDINGS CO LTD	147,374	72.200	10,640,402.800	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	17,565	228.000	4,004,820.000	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,925	2,300.000	13,627,500.000	
	PEGATRON CORP	160,827	78.300	12,592,754.100	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,276	1,075.000	13,196,700.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	131,742	173.500	22,857,237.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,851	1,045.000	6,114,295.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	61,247	102.000	6,247,194.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	874,943	25.750	22,529,782.250	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	335,078	44.750	14,994,740.500	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	5,934	1,395.000	8,277,930.000	
	WIWYNN CORP	7,037	1,810.000	12,736,970.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	260,470	117.500	30,605,225.000	
	SILERGY CORP	28,782	334.000	9,613,188.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	275,444	28.100	7,739,976.400	
	PHARMAESSENTIA CORP	17,593	347.500	6,113,567.500	
	MOMO.COM INC	6,487	521.000	3,379,727.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	17,128	515.000	8,820,920.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	17,704	326.000	5,771,504.000	
	台湾・ドル 小計	29,347,302		2,709,325,063.160 (12,693,458,853)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	8,878	161.000	1,429,358.000	
	BIDVEST GROUP LTD	23,375	273.020	6,381,842.500	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	286.010	5,490,247.960	
	DISCOVERY LTD	43,836	130.290	5,711,392.440	
	GOLD FIELDS LTD	76,688	238.290	18,273,983.520	
	REMGRO LTD	42,134	140.100	5,902,973.400	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	43,521	84.480	3,676,654.080	
	EXXARO RESOURCES LTD	22,354	190.630	4,261,343.020	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,482	1,916.910	14,342,320.620	
	MTN GROUP LTD	145,498	93.140	13,551,683.720	
	FIRSTSTRAND LTD	425,155	63.580	27,031,354.900	
	NASPERS LTD	16,610	3,180.000	52,819,800.000	
	NEDBANK GROUP LTD	36,051	207.400	7,476,977.400	

ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,345	622.940	3,952,554.300	
SASOL LTD	48,944	223.020	10,915,490.880	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	43,396	251.280	10,904,546.880	
STANDARD BANK GROUP LTD	113,979	192.720	21,966,032.880	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,293	70.910	5,480,846.630	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	171.280	5,167,003.760	
ABSA GROUP LTD	72,959	177.410	12,943,656.190	
SANLAM LTD	152,460	68.570	10,454,182.200	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	69,363	73.010	5,064,192.630	
KUMBA IRON ORE LTD	5,386	522.030	2,811,653.580	
OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	42.630	2,999,020.500	
VODACOM GROUP PTY LTD	51,270	107.600	5,516,652.000	
NEPI ROCKCASTLE NV	35,926	105.620	3,794,504.120	
OLD MUTUAL LTD	391,487	12.050	4,717,418.350	
REINET INVESTMENTS SCA	11,809	422.060	4,984,106.540	
PEPKOR HOLDINGS LTD	169,735	18.500	3,140,097.500	
SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	21.700	4,861,646.300	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	34,487	109.670	3,782,189.290	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	36,704	299.170	10,980,735.680	
BID CORP LTD	28,937	426.850	12,351,758.450	
南アフリカ・ランド 小計	2,585,814		313,138,220.220 (2,533,288,202)	
合計	598,779,633		82,529,973,979 (82,529,973,979)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年11月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	99,800.000	3,381,224.000		
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	29,700.000	886,248.000		
		ENERGISA SA	19,800.000	997,326.000		
		KLABIN SA	59,500.000	1,353,625.000		
	ブラジル・リアル 小計			208,800.000	6,618,423.000 (204,379,550)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,288,275.000	15,794,251.500		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,100.000	6,277,515.000		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	164,795.000	34,605,302.050		
		GRUPO TELEVISIA SAB	216,600.000	1,823,772.000		
	メキシコ・ペソ 小計			1,712,770.000	58,500,840.550 (502,797,173)	
投資信託受益証券 合計			1,921,570	707,176,723 (707,176,723)		

投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	6,758,334.000	
	メキシコ・ペソ 小計		235,400.000	6,758,334.000 (58,085,855)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	305,735.000	3,142,955.800	
	南アフリカ・ランド 小計		305,735.000	3,142,955.800 (25,426,512)	
投資証券 合計			541,135	83,512,367 (83,512,367)	
合計				790,689,090 (790,689,090)	

(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 47銘柄	2.59	—	—	2.74
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.26	—	—	1.34
インド・ルピー	株式 122銘柄	14.90	—	—	15.77
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.77	—	—	1.88
オフショア・人民元	株式 497銘柄	4.45	—	—	4.71
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.86	—	—	0.91
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.76	—	—	0.80
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.09	—	—	0.10
サウジアラビア・リアル	株式 42銘柄	3.88	—	—	4.11
タイ・バーツ	株式 41銘柄	1.71	—	—	1.81
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.15	—	—	0.16
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.44	—	—	0.47
トルコ・リラ	株式 18銘柄	0.64	—	—	0.68
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.24	—	—	0.25
フィリピン・ペソ	株式 14銘柄	0.59	—	—	0.62
ブラジル・レアル	株式 43銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	5.14 —	— 0.23	— —	5.69
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.85	—	—	0.90
マレーシア・リンギット	株式 32銘柄	1.33	—	—	1.40
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	1.73 — —	— 0.57 —	— — 0.07	2.51

ユーロ	株式	11銘柄	0.43	—	—	0.45
韓国・ウォン	株式	104銘柄	11.68	—	—	12.37
香港・ドル	株式	189銘柄	20.80	—	—	22.02
台湾・ドル	株式	90銘柄	14.39	—	—	15.23
南アフリカ・ランド	株式	33銘柄	2.87	—	—	3.07
	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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年11月30日現在

I 資産総額	52,797,198,187円
II 負債総額	325,725,160円
III 純資産総額 (I - II)	52,471,473,027円
IV 発行済数量	55,130,369,416口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	0.9518円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

I 資産総額	557,664,365,904円
II 負債総額	8,695,821,000円
III 純資産総額 (I - II)	548,968,544,904円
IV 発行済数量	443,253,798,014口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2385円

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11月30日現在

I 資産総額	483,445,824,627円
II 負債総額	223,089,395円
III 純資産総額 (I - II)	483,222,735,232円
IV 発行済数量	116,783,287,505口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	4.1378円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

I 資産総額	262,850,522,140円
II 負債総額	1,503,741,481円
III 純資産総額 (I - II)	261,346,780,659円
IV 発行済数量	224,807,826,614口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.1625円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年11月30日現在

I 資産総額	1,195,069,303,196円
II 負債総額	719,125,798円
III 純資産総額 (I - II)	1,194,350,177,398円
IV 発行済数量	158,799,662,749口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	7.5211円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年11月30日現在

I 資産総額	96,787,577,462円
II 負債総額	383,637,248円
III 純資産総額 (I - II)	96,403,940,214円
IV 発行済数量	43,393,962,817口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.2216円

I 資産総額	89,253,859,076円
II 負債総額	24,584,980円
III 純資産総額 (I - II)	89,229,274,096円
IV 発行済数量	57,819,826,820口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.5432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11月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2023年11月30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11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,517,087,272,118
追加型株式投資信託	779	15,334,220,929,811
単位型公社債投資信託	21	35,808,950,249
単位型株式投資信託	208	1,075,655,152,816
合計	1,034	17,962,772,304,994

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第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、第39期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

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

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	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) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 収益及び費用の計上基準	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いません。

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おります。

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

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	3,092	2,895
繰延税金負債	—	—
繰延税金負債合計	—	—
繰延税金資産の純額	3,092	2,895

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	—	26.87 %

(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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森重 俊寛

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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) 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) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,013
金銭の信託		28,384
未収委託者報酬		17,669
未収運用受託報酬		3,747
未収投資助言報酬		305
未収収益		13
前払費用		1,318
その他		2,504
	流動資産計	81,956
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	947
器具備品	※1	100
リース資産	※1	6
無形固定資産		
ソフトウェア		2,954
ソフトウェア仮勘定		2,002
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		184
関係会社株式		4,888
長期差入保証金		772
繰延税金資産		2,592
その他		120
	固定資産計	14,572
資産合計		96,529

(単位：百万円)

	第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	418
リース債務	1
未払金	7,850
未払収益分配金	1
未払償還金	0
未払手数料	7,654
その他未払金	193
未払費用	7,452
未払法人税等	2,372
未払消費税等	1,076
契約負債	20
賞与引当金	861
役員賞与引当金	26
流動負債計	20,081
固定負債	
リース債務	5
退職給付引当金	2,701
時効後支払損引当金	72
固定負債計	2,780
負債合計	22,861
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	52,115
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,991
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,311
株主資本計	73,668
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△0
評価・換算差額等計	△0
純資産合計	73,668
負債・純資産合計	96,529

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬		49,984	
運用受託報酬		8,063	
投資助言報酬		1,082	
その他営業収益		13	
	営業収益計		59,144
営業費用			
支払手数料		21,623	
広告宣伝費		107	
公告費		0	
調査費		17,657	
調査費		6,728	
委託調査費		10,928	
委託計算費		280	
営業雑経費		372	
通信費		17	
印刷費		253	
協会費		33	
諸会費		29	
支払販売手数料		38	
	営業費用計		40,042
一般管理費			
給料		4,831	
役員報酬		77	
給料・手当		4,735	
賞与		19	
交際費		14	
寄付金		3	
旅費交通費		63	
租税公課		175	
不動産賃借料		508	
退職給付費用		206	
固定資産減価償却費	※1	749	
福利厚生費		17	
修繕費		0	
賞与引当金繰入額		861	
役員賞与引当金繰入額		26	
機器リース料		0	
事務委託費		1,714	
事務用消耗品費		24	
器具備品費		0	
諸経費		120	
	一般管理費計		9,319
営業利益			9,782

(単位：百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	3	
受取配当金	3	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	35	
雑収入	10	
営業外収益計		53
営業外費用		
為替差損	7	
金銭の信託運用損	785	
早期割増退職金	0	
雑損失	3	
営業外費用計		797
経常利益		9,038
特別損失		
固定資産除却損	2	
関係会社株式評価損	922	
特別損失計		924
税引前中間純利益		8,113
法人税、住民税及び事業税		2,136
法人税等調整額		303
法人税等合計		2,440
中間純利益		5,673

(3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678
当中間期変動額							
剰余金の配当							△11,040
中間純利益							5,673
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	—	—	—	—	—	—	△5,366
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,311

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	57,481	79,034	△0	△0	79,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	△11,040	△11,040			△11,040
中間純利益	5,673	5,673			5,673
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		—	△0	△0	△0
当中間期変動額 合計	△5,366	△5,366	△0	△0	△5,366
当中間期末残高	52,115	73,668	△0	△0	73,668

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)</p> <p>市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p>	<p>時価法</p>
<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<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、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>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>
<p>4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</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、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投</p>

6. 収益及び費用の計上基準

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。

(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。

(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。

(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。

(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。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)		
※1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	…	577百万円
	器具備品	…	764百万円
	リース資産	…	2百万円

(中間損益計算書関係)

項目	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)		
※1. 減価償却実施額	有形固定資産	…	71百万円
	無形固定資産	…	678百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類 株式				

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

(金融商品関係)

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	28,384	28,384	—
(2) 投資有価証券 その他有価証券	1	1	—
資産計	28,386	28,386	—

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価 (百万円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	—	28,384	—	28,384
投資有価証券	—	—	—	—
その他有価証券	—	1	—	1
資産計	—	28,386	—	28,386

(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す。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。
これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券 (その他有価証券)	
非上場株式	182
関係会社株式	
非上場株式	4,888

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

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(中間貸借対照表計上額4,888百万円)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

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額182百万円)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。

(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。

(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) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	－百万円
固定資産	65,400百万円
資産合計	65,400百万円
流動負債	－百万円
固定負債	3,358百万円
負債合計	3,358百万円
純資産	62,041百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額49,546百万円及び顧客関連資産の金額19,028百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	－百万円
営業利益	△3,824百万円
経常利益	△3,824百万円
税引前中間純利益	△3,824百万円
中間純利益	△3,237百万円
1株当たり中間純利益	△80,925円14銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額1,918百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第39期中間会計期間
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

委託者報酬	49,984百万円
運用受託報酬	7,464百万円
投資助言報酬	1,082百万円
成功報酬(注)	599百万円
その他営業収益	13百万円
合計	59,144百万円

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

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。

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,841,700円33銭
1株当たり中間純利益金額	141,837円37銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益金額	5,673百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	5,673百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社に対する出資比率が、2023年10月6日付で49.9%から23.4%に引き下がりました。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

約 款

追加型証券投資信託
リスクコントロール世界資産分散ファンド
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者の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、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（E T F）に投資する場合があります。また、「D I A Mマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

(2) 投資態度

①以下のマザーファンド受益証券、有価証券指数等先物取引、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（E T F）等への投資を通じて、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（以下「各資産」ということがあります。）に実質的に分散投資を行います。

- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・J-R E I T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
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド

（上記マザーファンドおよびD I A Mマネーマザーファンドを以下「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

上記のほか、D I A Mマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

②各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。その後各資産のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度^{※1}となるよう最終的に基本配分比率を決定します^{※2}。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託者が必要と判断した場合には、適宜見直しを行うことがあります。

※1 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は基本資産配分に基づくポートフォリオの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

※2 実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

③基準価額の下落を一定水準（下値目安値^(*)）までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託者の判断により過去1年間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託者の判断により今後変更する場合があります。

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

(**) 合計資産比率とは、「D I AMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。

④ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

①各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②株式への実質投資割合には、制限を設けません。

③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④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。

⑤同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。

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。

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（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。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

②分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して、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留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
リスクコントロール世界資産分散ファンド
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1,000億円を上限として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1兆円を限度として、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2028年5月11日までとします。

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

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条の規定によって生じた受益権については1,000億口を上限に、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、受託者と協議のうえ、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。

<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この信託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および第30条に規定する借入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

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32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。

<信託日時の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とし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの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。)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、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、委託者が定める申込単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。ただし、委託者に対し、取得申込みにかかる受益権について、第47条第3項に規定する収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みをした取得申込者に対しては、1口単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

- 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、その取得申込者に対し、販売会社が定める申込単位をもって取得申込みに応ずることができます。ただし、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって契約(以下「別に定める契約」といいます。)を結んだ取得申込者に限り、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。
- ③前2項の場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に委託者または販売会社がそれぞれ別に定める手数料ならびに当該手数料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。)に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる価額は、1口につき1円に、委託者または販売会社がそれぞれ別に定める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加算した価額とします。

- ④第1項および第2項の規定にかかわらず、取得申込日がニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」といいます。）には、受益権の取得申込みに応じません。ただし、第47条第3項の規定または別に定める契約に基づく収益分配金の再投資にかかる場合は除きます。
- ⑤第3項の規定にかかわらず、受益者が第47条第3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41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49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3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、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込みの受付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ます。
- 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ます。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ます。
- 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ます。
- 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24条、第25条および第26条に定めるものに限りません。）
 - 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親投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-R E I T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、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、D I A Mマネーマザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を含む次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 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。）
8. 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。）
9. 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。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 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
12. 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
13. 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ます。）
14. 投資証券、新投資口予約権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、次号で定めるものを除きます。）
15. 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ます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
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12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6号までの証券ならびに第15号の証券ならびに第12号および第18号の証券または証書のうち第2号から第6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13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- 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第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ④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（不動産投資信託証券については、予定を含みます。）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。以下同じ。）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。
- ⑤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受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める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つ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33条において同じ。）、第33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23条から第26条、第28条から第30条、第32条、第36条から第38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また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23条から第26条、第28条から第30条、第32条、第36条から第38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、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、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託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。

<同一銘柄の上場投資信託証券への投資制限>

第21条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の上場投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該上場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、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがリスクスルーできる場合に該当しないときは、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

②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受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該上場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。

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第22条 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23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24条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価

証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

<スワップ取引の運用指図>

第25条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第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スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④前項においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ⑥委託者は、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るときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図>

第26条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第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金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④前項においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)

が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産（「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下本項において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- ⑥前項においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ⑧委託者は、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るときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第27条 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしがたい、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28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るときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

<公社債の空売りの指図および範囲>

第29条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債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、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引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前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。
- ③信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

<公社債の借入れの指図および範囲>

第30条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を

行うものとします。

- ②前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④第1項の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

<特別な場合の外貨建有価証券への投資制限>

第31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32条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②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とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③前項においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ④第2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、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

<信託業務の委託等>

第33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34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35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36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37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38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39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40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41条 この信託の計算期間は、原則として毎年11月12日から翌年11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2018年11月12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42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43条 信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額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前項の信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額は、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44条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第41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年10,000分の99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45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、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、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、繰越欠損金のあるとき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前項各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46条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、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47条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第50条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第47条第5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、償還金および一部解約金の支払い>

第47条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、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、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せん。）に支払います。

②前項の規定にかかわらず、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。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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。

③委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部または一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申し出を受けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）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の申込みに応じたものとします。当該受益権の取得申込みに応じた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。

④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せん。）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。

- ⑤一部解約金は、第50条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から受益者に支払います。
- ⑥前各項（第2項および第3項を除きます。）に規定する収益分配金、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収益分配金、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。
- ⑦収益分配金、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、各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。
- ⑧前項に規定する「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、各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、前項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各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。

<収益分配金および償還金の時効>

第48条 受益者が、収益分配金について第47条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、信託終了による償還金については第47条第4項に規定する支払開始日から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。

<委託者の自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第49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。

<信託契約の一部解約>

- 第50条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に委託者または販売会社が定める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受付日が海外休業日の場合は、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。
- ②委託者は、前項の一部解約の実行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。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この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受付日の翌営業日の基準価額とします。
 - ④受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、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、決済機能の停止、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51条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、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、この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、この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、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

- 第52条 委託者は、監督官庁よりこの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、この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信託約款を変更しようとするときは、第56条の規定にしたがいます。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

- 第53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、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの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56条第2項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54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、この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または一部を承継させることがあり、これに伴い、この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55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56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、上記によって行う場合を除き、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、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

<信託約款の変更等>

- 第56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、この信託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、この信託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、この信託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。
- ④第2項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。
- 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、この信託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。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、この投資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。

<反対受益者の受益権買取請求の不適用>

第57条 この信託は、受益者が第50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51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。

<信託期間の延長>

第58条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

<他の受益者の氏名等の開示の請求の制限>

第59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60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61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つた場合には、これを交付します。

<質権口記載または記録の受益権の取扱い>

第62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け、一部解約金および償還金の支払い等については、この信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第63条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

第1条 この信託約款において「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、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、

第2条 第26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26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。

2018年5月25日

委託者 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
アセットマネジメント One 株式会社

受託者 東京都中央区八重洲一丁目2番1号
みずほ信託銀行株式会社

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
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
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
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的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、為替ヘッジあり）」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外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。
- 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。
- ⑦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株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
- ②株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ⑥有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦スワップ取引を行うことができます。
- ⑧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。
- ⑨外国為替予約取引を行うことができます。
- 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
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。

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
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
D I A Mマネーマザーファンド
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、安定した収益の確保をめざします。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（*）の長期発行体格付け（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。

（*）主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody's、S&Pとします。

②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。

③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。

④資金動向、市況動向に急激な変化が生じた場合、残存信託期間、残存元本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できない場合があります。

(3) 投資制限

①株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。

②同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑤投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑥有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引は約款の範囲で行う事ができます。

⑦外貨建て資産への投資は行いません。

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。

⑨一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。