

# クルーズコントロール

追加型投信／内外／資産複合

- この目論見書により行う「クルーズコントロール」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2023年10月11日に関東財務局長に提出しており、2023年10月12日にその効力が生じております。
- 「クルーズコントロール」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】	73
第3【ファンドの経理状況】	81
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	306
第三部【委託会社等の情報】	308
第1【委託会社等の概況】	308
約款	337

## 第一部【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

クルーズコントロール

(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<sup>※</sup>とします。

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

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

<基準価額の照会方法等>

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

※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、3.3%(税抜3.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### (6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、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：2023年10月12日から2024年4月11日まで

※ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、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、販売会社に買付代金を支払うものとします。

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <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。

当ファンドでは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、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、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、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なります。

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、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

## 1 国内外の6資産に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

- 国内外の株式および公社債に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。
  - ・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
  - ・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
  - ・エマーGING債券パッシブ・マザーファンド
  - ・エマーGING株式パッシブ・マザーファンド
- マザーファンドのほか、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)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
- 実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。
- 各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

## 2 基準価額の下落を一定水準(下値目安値<sup>(\*)</sup>)までに抑えることを目標とします。

- 資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
- 資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
- 下値目安値は、3ヵ月毎に下値目安値の改定日(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には、翌営業日。)を設け、改定日における基準価額から-2.0%の水準とします。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。
- 上記の運用目標は、現金等<sup>(\*\*)</sup>を活用し、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<sup>(\*\*\*)</sup>を機動的に変更することで行います。

(\*)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)。

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

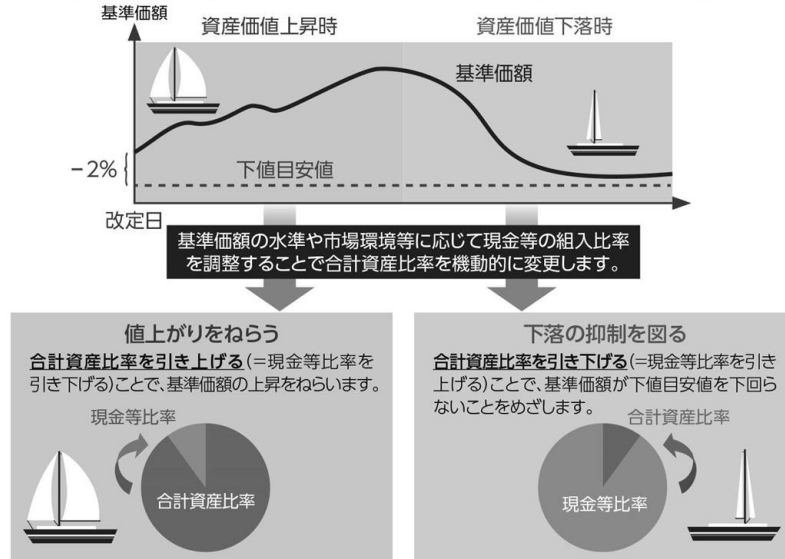
(\*\*\*)合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

※各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

## 当ファンドの合計資産比率の変更(イメージ)

- 資産価値上昇時は、合計資産比率\*1を増加(=現金等\*2比率の減少)させることで値上がり益の獲得をめざします。
- 一方、資産価値下落時は、機動的に合計資産比率を減少(=現金等比率の増加)させることで基準価額下落の抑制をめざします。

\*1 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。  
 \*2 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。  
 ※合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。



※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。  
 ※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。  
 ※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。  
 ※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。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2回の決算時(毎年1月、7月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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



○商品分類表

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

(注) 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

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

○属性区分表

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

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

(注) 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

資産複合 (投資信託証券 (債券、株式)、 先物、E T F、 短期金融資産) 資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、E T F、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル (日本を含む)	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います。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

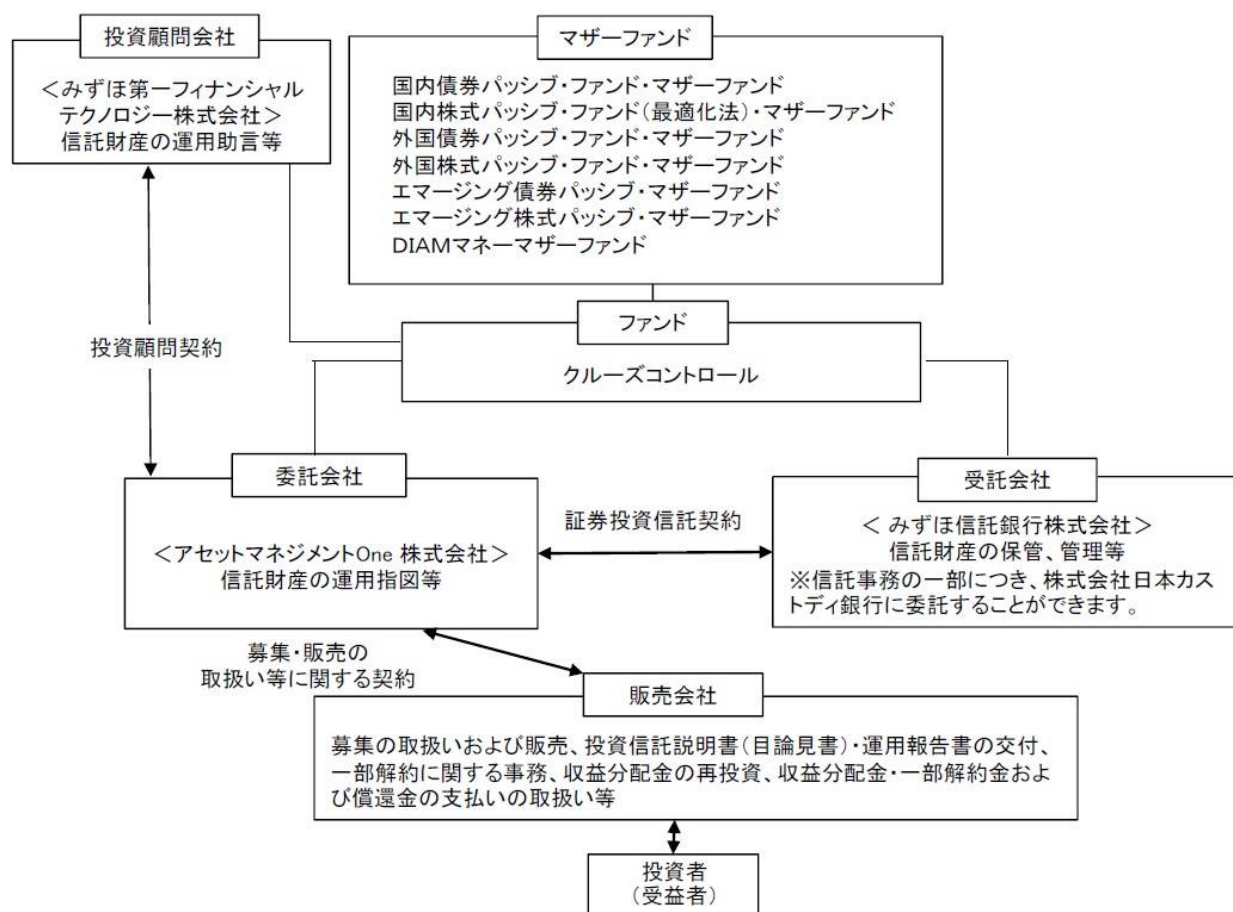
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2012年10月26日	信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2013年 5月17日	投資対象、投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

### (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、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マザーファンドにて行う仕組みです。



(\*)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。

○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2023年7月31日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

(2023年7月31日現在)

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

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、「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、「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目指す上場している投資信託証券（ETF）、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

#### <投資態度>

①以下のマザーファンドへの投資を通じて、国内外の株式、公社債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

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

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

（上記それぞれおよびDIAMマネーマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

- ・上記のほか、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）、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。
- ・実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

- ②各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。
- ・ 経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。
- ③基準価額の下落を一定水準（下値目安値<sup>(\*)</sup>）までに抑えることを目標とします。
- ・ 資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
  - ・ 資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
  - ・ 下値目安値は、四半期毎に、委託会社の判断により基準価額から一定の水準に設定します。
  - ・ 上記の運用目標は、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<sup>(\*\*)</sup>を機動的に変更することで行います。
- (\*) 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6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。
- ・ 各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。
  - ・ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

#### <運用プロセス>

- ・ **基本配分比率の決定**  
委託会社は、年に一度、統計的手法を用いて現金等を除く各資産への基本配分比率を決定します。
- ・ **下値目安値の決定**  
委託会社は、3ヵ月に一度、下値目安値の改定日を設け、当日の基準価額の98%の水準を翌3ヵ月間の下値目安値とします。
- ・ **リバランスの実施**  
委託会社は、各資産の上昇益を享受しつつも基準価額が下値目安値を下回らないことを目標として、基準価額と下値目安値の水準、市況などを基に、日々の合計資産比率の推奨値を決定します。ファンドの合計資産比率と推奨値との乖離が一定以上となった場合にはリバランスを実施します。6資産への投資比率は、基本配分比率と合計資産比率から決定します。
- ・ **みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言**  
基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

## (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。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### ②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債券のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）



11. コマーシャル・ペーパー
  12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. ～12. の証券または証書の性質を有するもの
  14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
  15. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
  18. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  20. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で22. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書、13. および18. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から7. までの証券ならびに13. および18. の証券または証書のうち2. から7. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. の証券および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

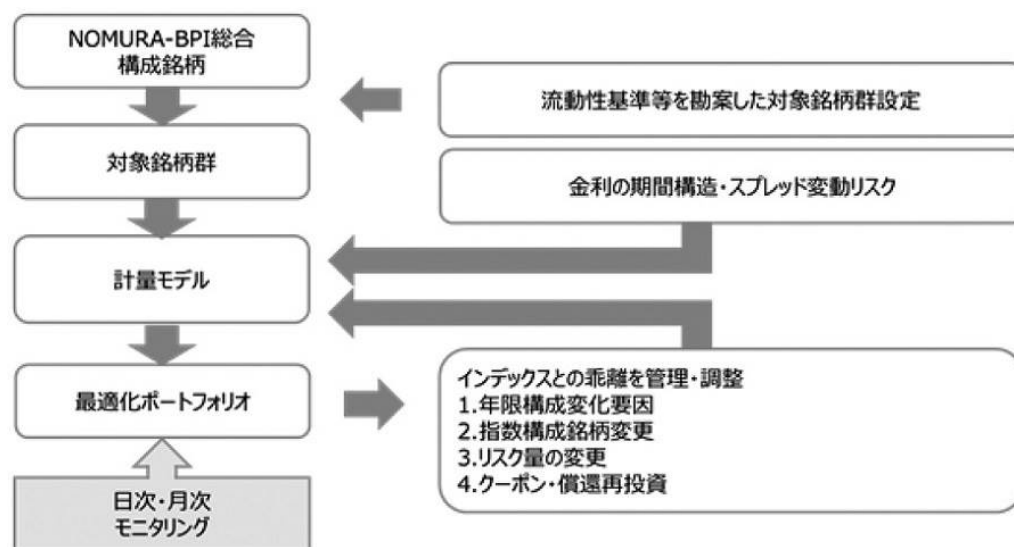
### ③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

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

(参考) 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>
	<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&amp;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&amp;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>
運用プロセス	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA-BPI 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因</p> <p>2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン、償還再投資</li> </ul>



<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
---------------	--

<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>

投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin-top: 10px;"> <p>※①東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>②JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（TOPIX）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>③JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>④JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p> <p>⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</p> <p>⑧以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</p> </div>
運用プロセス	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定</li> </ol>

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

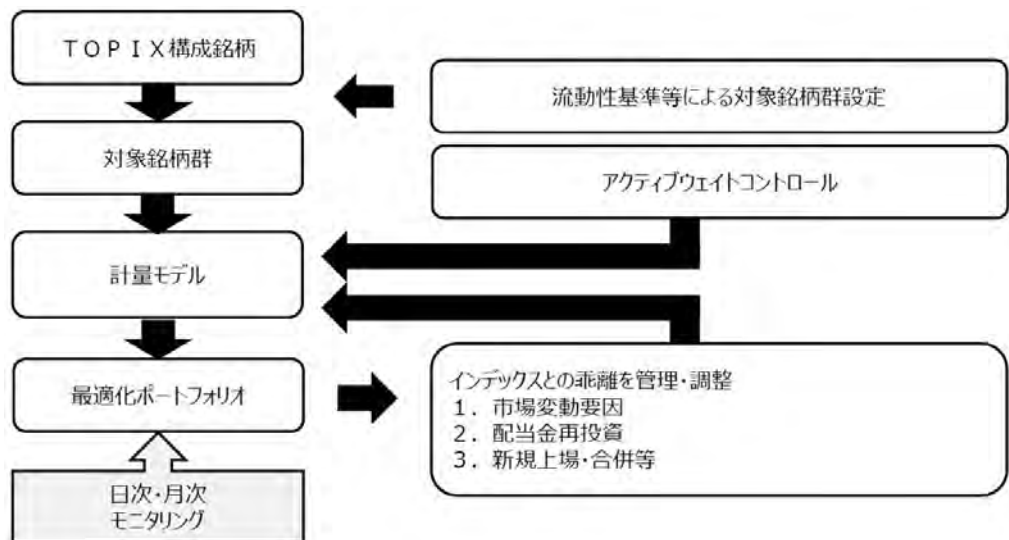
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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。

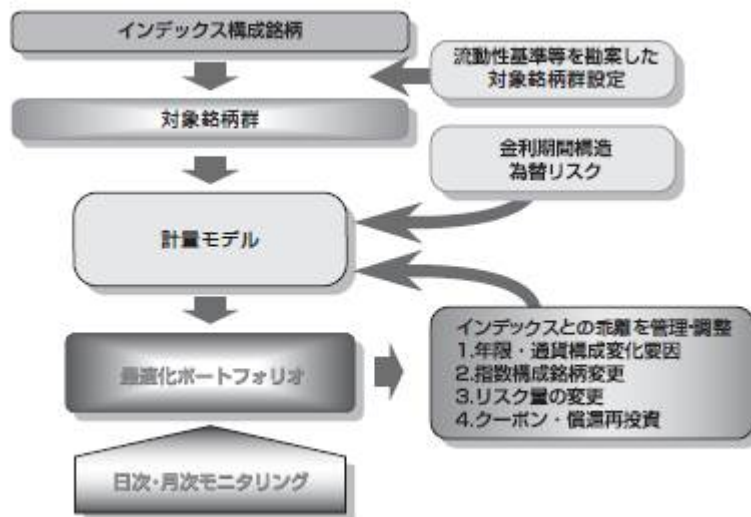
- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定



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	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標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産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>※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p>
運用プロセス	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 年限・通貨構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン・償還再投資</li> </ul>



<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>2. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
---------------	--

<p>ファンド名</p>	<p>外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の株式を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

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

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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、または



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

運用プロセス

1. 流動性基準による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

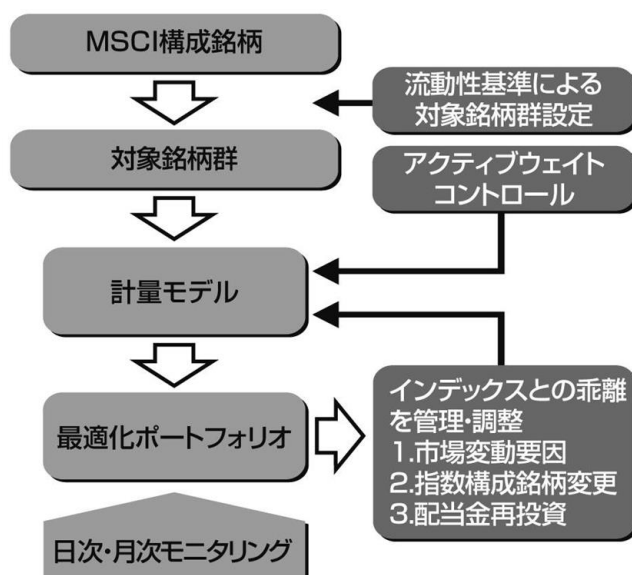
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



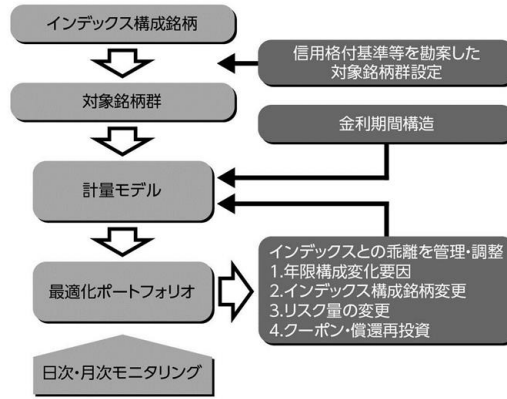
主な投資制限

1. 株式への投資割合には、制限を設けません。
2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。

3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。
4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	エマージング債券パッシブ・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	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>3. 組入債券は、当初組入時において、S &amp; PもしくはM o o d y ' s の外貨建て長期格付がB B ー格もしくは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。</li> <li>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。</li> </ol> <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	

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。



主な投資制限

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

ファンド名	エマージング株式パッシブ・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。 （*）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。
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	1. 主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）*の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、株式の組入比率は高位を維持します。 3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
※本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会	

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

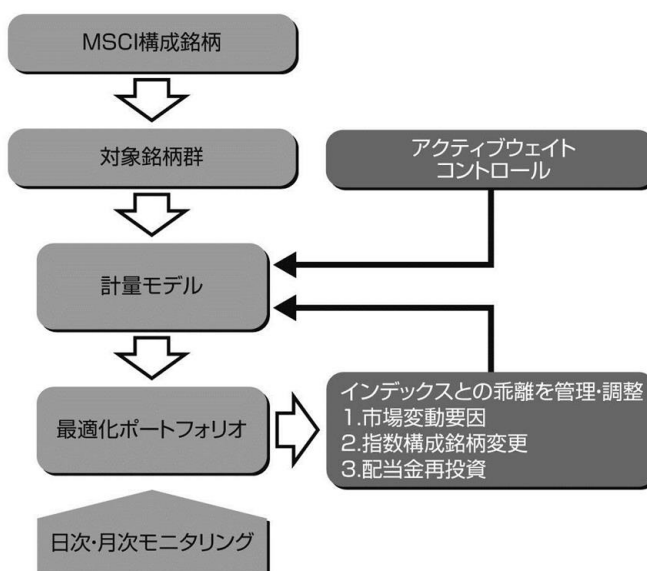
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前に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。

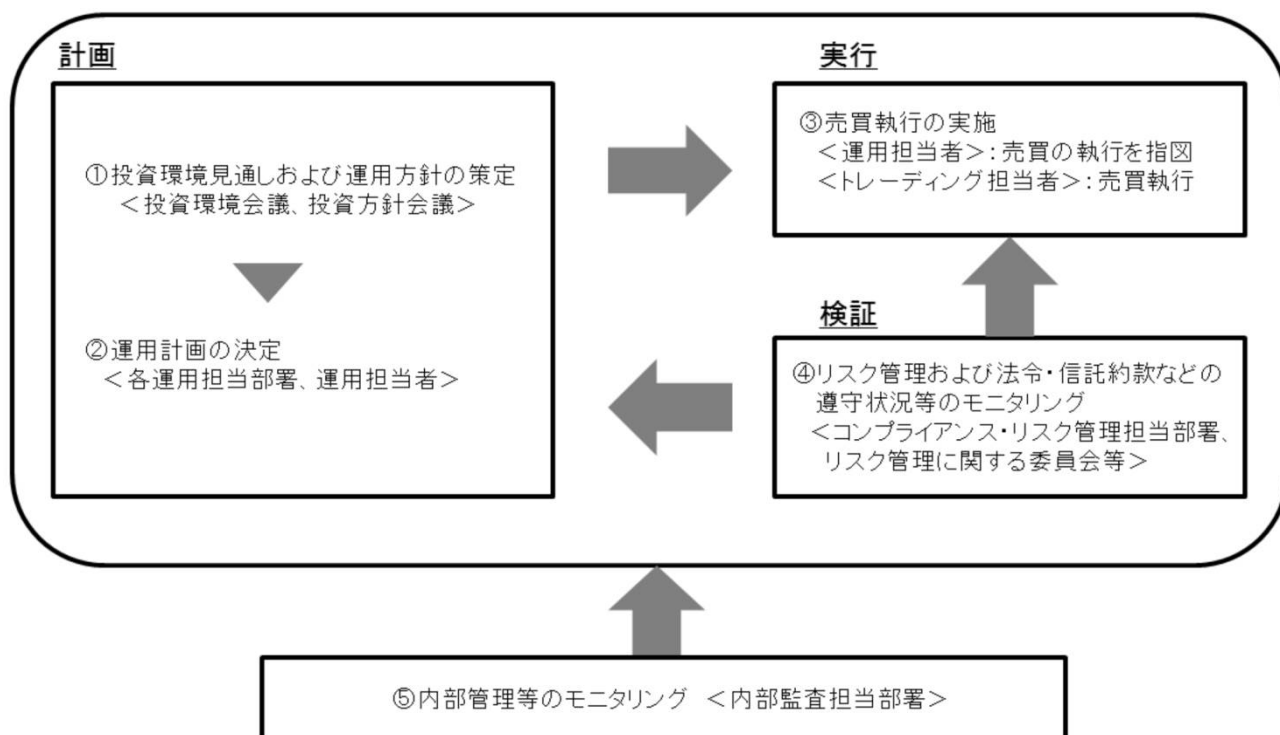
ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	<p>①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（*）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>（*）主要格付機関とは、R&amp;I、JCR、Moody's、S&amp;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張等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。</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。

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

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

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

#### (4) 【分配方針】

##### ①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

##### (1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### (2) 分配対象額についての分配方針

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

##### (3) 留保益の運用方針

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

##### ②収益の分配方式

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

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



お、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

(2) 上記(1)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、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

## (5) 【投資制限】

- 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委託会社は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。以下同じ。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。（約款第17条第3項）
- ④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）
- ⑤非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）については制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限）
- 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。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限）

⑦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、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。

⑧信用取引の指図および範囲（約款第21条）

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

⑨先物取引等の運用指図（約款第22条）

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

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

⑩スワップ取引の運用指図（約款第23条）

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

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

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

⑭特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26条）

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

⑮外国為替予約取引の指図（約款第27条）

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

⑯資金の借入れ（約款第33条）

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

⑰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等は、基準価額の下落要因となります。

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

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。

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

#### ・金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

#### ・信用リスク

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

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、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

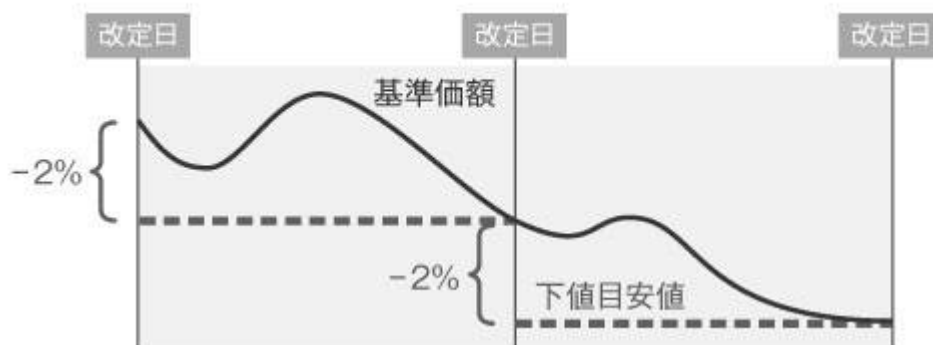
○当ファンドは下値目安値を改定日の基準価額をもとに決定し、損失の抑制をめざして合計資産比率をコントロールします。ただし損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意く

ださい。

<ケース①> 下値目安値の切下げについて

下値目安値は3ヵ月（四半期）毎の改定日にその時点の基準価額をもとに定められます。そのため、当ファンドの基準価額は長期的に2%以上下落する場合があります。

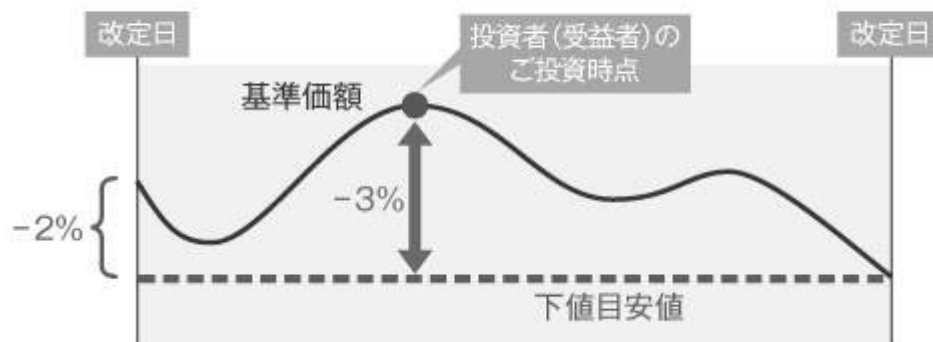
### <基準価額の推移(イメージ)>



<ケース②> 四半期中途の投資について

当ファンドの基準価額が直近の改定日の基準価額よりも上昇し、この時点でお客さまが当ファンドへ投資された場合、次回改定日までの基準価額の下落は2%以上となる場合があります。したがって、ご投資にあたっては、当該四半期の下値目安値にご留意いただきますようお願いいたします。

### <基準価額の推移(イメージ)>



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

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

- 資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。
- 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。
- 当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象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。

○注意事項

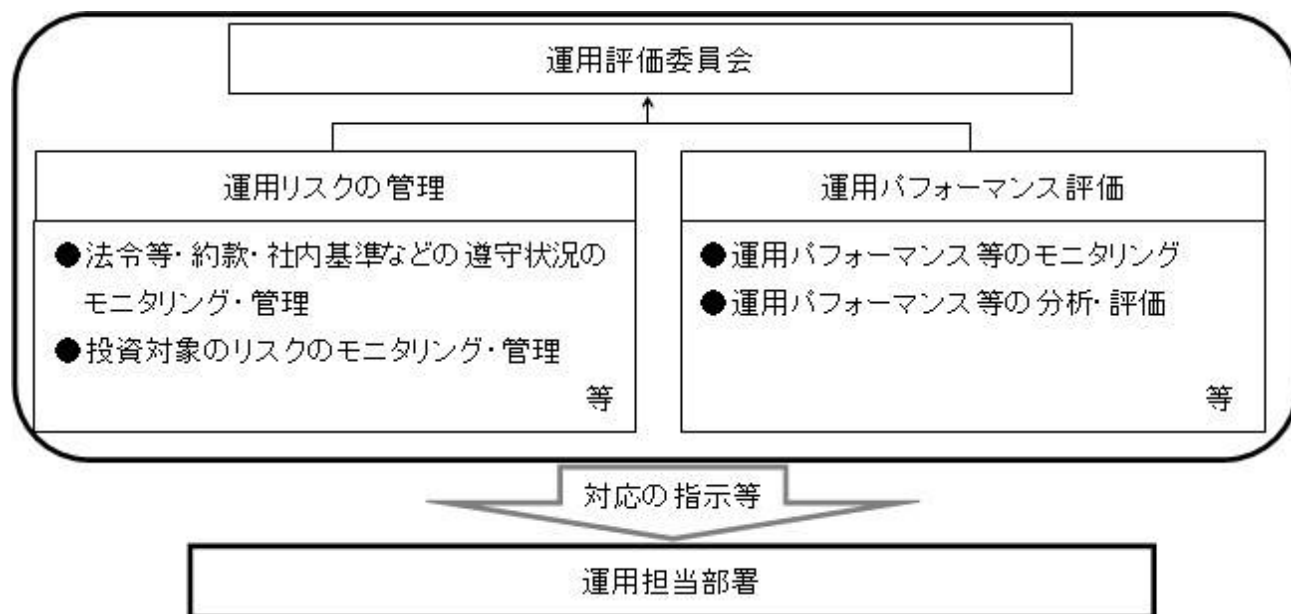
- イ. 当ファンドは、実質的に債券および株式等など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。



### <リスク管理体制>

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

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



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

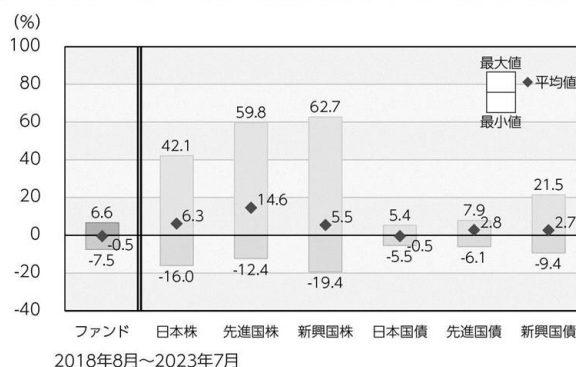
※リスク管理体制は2023年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%(税抜3.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

##### (2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3) 【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.54%（税抜1.40%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.65%	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0.70%	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0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (4) 【その他の手数料等】

###### 1. 信託財産留保額

ありません。

###### 2. その他の費用

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

①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に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、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## （５）【課税上の取扱い】

◇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。

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

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

<2024年1月1日以降>

少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### ○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

#### ◇個別元本方式について

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

<個別元本について>

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取

得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

- 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
1.56%	1.54%	0.02%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年1月12日~2023年7月11日

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

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

※なお、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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	7,625,213,399	74.32
内 日本	7,625,213,399	74.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,634,378,909	25.68
純資産総額	10,259,592,308	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7月31日現在

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

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

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年7月31日現在

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

その他資産の投資状況

2023年7月31日現在

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

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）

国債証券		227,434,478,182	98.72
内 アメリカ		110,460,072,593	47.95
内 フランス		19,002,203,404	8.25
内 イタリア		17,635,345,883	7.65
内 ドイツ		15,104,016,989	6.56
内 中国		12,901,594,716	5.60
内 スペイン		11,503,844,976	4.99
内 イギリス		11,283,525,836	4.90
内 カナダ		4,585,612,114	1.99
内 ベルギー		4,201,957,918	1.82
内 オランダ		3,594,898,940	1.56
内 オーストラリア		3,401,116,199	1.48
内 オーストリア		2,860,380,455	1.24
内 メキシコ		2,283,127,436	0.99
内 アイルランド		1,370,927,404	0.60
内 フィンランド		1,217,321,460	0.53
内 マレーシア		1,174,356,211	0.51
内 ポーランド		1,174,179,746	0.51
内 シンガポール		1,013,419,931	0.44
内 デンマーク		711,887,115	0.31
内 イスラエル		649,579,786	0.28
内 ニュージーランド		482,027,137	0.21
内 スウェーデン		460,689,084	0.20
内 ノルウェー		362,392,849	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,950,415,362	1.28
純資産総額		230,384,893,544	100.00

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	1,063,006,420,772	96.30
内 アメリカ	755,575,919,164	68.45
内 イギリス	44,407,373,886	4.02
内 カナダ	37,317,785,117	3.38
内 フランス	35,536,913,006	3.22
内 スイス	35,325,332,137	3.20
内 ドイツ	27,080,040,803	2.45
内 オランダ	21,703,039,887	1.97
内 オーストラリア	21,397,281,038	1.94
内 アイルランド	19,940,419,983	1.81
内 スウェーデン	9,380,064,568	0.85
内 デンマーク	9,255,487,087	0.84
内 スペイン	8,015,367,519	0.73
内 香港	5,948,305,546	0.54
内 イタリア	5,915,846,631	0.54
内 ジャージー	3,829,533,015	0.35
内 シンガポール	3,560,867,698	0.32
内 フィンランド	3,416,477,957	0.31



	内 ベルギー	2,433,310,554	0.22
	内 イスラエル	2,059,605,937	0.19
	内 ノルウェー	2,052,773,998	0.19
	内 ケイマン諸島	1,937,748,431	0.18
	内 バミューダ	1,696,803,514	0.15
	内 オランダ領キュラソー	1,622,678,899	0.15
	内 ニュージーランド	832,632,792	0.08
	内 ポルトガル	572,763,838	0.05
	内 ルクセンブルグ	561,075,905	0.05
	内 オーストリア	558,335,029	0.05
	内 リベリア	487,207,658	0.04
	内 パナマ	344,821,161	0.03
	内 マン島	240,608,014	0.02
投資信託受益証券		1,744,727,108	0.16
	内 オーストラリア	1,281,818,211	0.12
	内 シンガポール	462,908,897	0.04
投資証券		20,353,382,371	1.84
	内 アメリカ	19,088,798,647	1.73
	内 イギリス	447,051,663	0.04
	内 フランス	375,861,181	0.03
	内 香港	278,678,893	0.03
	内 ベルギー	85,064,732	0.01
	内 カナダ	77,927,255	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		18,766,718,662	1.70
純資産総額		1,103,871,248,913	100.00

その他資産の投資状況

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	19,286,630,167	1.75
内 アメリカ	14,513,605,116	1.31
内 ドイツ	2,883,971,772	0.26
内 イギリス	835,458,840	0.08
内 カナダ	656,117,800	0.06
内 オーストラリア	397,476,639	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	122,685,214,143	97.48
内 サウジアラビア	13,364,527,431	10.62
内 メキシコ	12,460,145,488	9.90
内 アラブ首長国連邦	9,711,383,402	7.72
内 カタール	9,311,533,700	7.40
内 チリ	8,374,715,500	6.65
内 コロンビア	8,139,396,508	6.47

内 ブラジル	8,058,351,318	6.40
内 ドミニカ共和国	7,763,143,408	6.17
内 ハンガリー	7,622,132,589	6.06
内 パナマ	6,302,853,634	5.01
内 インドネシア	6,280,597,924	4.99
内 南アフリカ	6,037,939,073	4.80
内 ルーマニア	4,475,917,887	3.56
内 ペルー	4,373,320,647	3.47
内 フィリピン	3,898,337,996	3.10
内 オマーン	3,842,846,992	3.05
内 ウルグアイ	1,794,370,521	1.43
内 中国	873,700,125	0.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,167,824,342	2.52
純資産総額	125,853,038,485	100.00

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

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

	内 シンガポール	27,692,051	0.02
	内 ペルー	25,914,901	0.02
	内 ロシア	0	0.00
	内 キプロス	0	0.00
	内 イギリス領バージン諸島	0	0.00
投資信託受益証券		889,663,678	0.76
	内 メキシコ	635,187,588	0.55
	内 ブラジル	254,476,090	0.22
投資証券		109,608,324	0.09
	内 メキシコ	64,808,225	0.06
	内 南アフリカ	44,800,099	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,866,883,607	5.04
純資産総額		116,303,372,564	100.00

その他資産の投資状況

2023年7月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

D I A Mマネーマザーファンド

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	300,136,000	61.62
内 日本	300,136,000	61.62
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	186,969,557	38.38
純資産総額	487,105,557	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	外国債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,006,326,878	2.1473 2,160,894,210	2.1569 2,170,546,443	— —	21.16
2	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	373,409,746	3.8671 1,444,014,809	4.0083 1,496,738,284	— —	14.59
3	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	1,137,199,668	1.2637 1,437,130,677	1.2505 1,422,068,184	— —	13.86

4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	485,490,781	1.4879 722,379,859	1.5690 761,735,035	— —	7.42
5	外国株式パッシブ・ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	102,821,202	7.0269 722,519,729	7.2676 747,263,367	— —	7.28
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	340,326,666	2.1163 720,234,603	2.1475 730,851,515	— —	7.12
7	D I A Mマナーマザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	294,245,101	1.0060 296,039,996	1.0060 296,010,571	— —	2.89

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	74.32
合計	74.32

(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7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,530,000,000	100.32 4,544,681,000	100.23 4,540,645,500	0.1 2025/6/20	0.98
2	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,460,000,000	99.64 4,444,325,000	99.81 4,451,749,000	0.1 2028/3/20	0.96
3	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,250,000,000	100.36 4,265,455,000	100.24 4,260,412,500	0.1 2025/9/20	0.92
4	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,280,000,000	98.22 4,204,150,000	97.47 4,171,972,800	0.2 2032/3/20	0.90
5	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,250,000,000	97.44 4,141,334,000	97.06 4,125,135,000	0.1 2031/9/20	0.89
6	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,110,000,000	99.89 4,105,520,000	99.78 4,101,204,600	0.005 2027/6/20	0.88
7	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,090,000,000	100.32 4,103,120,000	100.25 4,100,593,100	0.1 2026/6/20	0.88

8	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,150,000,000	98.40 4,083,600,000	98.28 4,078,869,000	0.1 2030/6/20	0.88
9	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,070,000,000	99.80 4,061,885,000	100.08 4,073,337,400	0.1 2027/9/20	0.88
10	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,100,000,000	98.67 4,045,556,000	97.98 4,017,426,000	0.1 2030/9/20	0.86
11	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,980,000,000	100.99 4,019,402,000	100.80 4,011,879,800	0.4 2025/6/20	0.86
12	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	4,020,000,000	100.88 4,055,770,000	99.50 4,000,261,800	0.5 2032/12/20	0.86
13	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,850,000,000	99.52 3,831,798,000	99.49 3,830,403,500	0.1 2028/9/20	0.82
14	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,790,000,000	99.73 3,779,767,000	99.36 3,765,781,900	0.1 2028/12/20	0.81
15	143回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	3,700,000,000	100.32 3,711,860,000	100.21 3,707,844,000	0.1 2025/3/20	0.80
16	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,690,000,000	100.04 3,691,476,000	100.15 3,695,719,500	0.1 2027/6/20	0.79
17	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,690,000,000	99.52 3,672,288,000	99.66 3,677,454,000	0.1 2028/6/20	0.79
18	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,620,000,000	100.90 3,652,580,000	100.73 3,646,751,800	0.3 2025/12/20	0.78
19	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,750,000,000	99.41 3,728,124,000	96.99 3,637,387,500	0.2 2032/9/20	0.78
20	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,710,000,000	97.71 3,625,181,000	97.52 3,618,177,500	0.1 2031/3/20	0.78
21	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,700,000,000	98.79 3,655,499,000	97.24 3,597,917,000	0.2 2032/6/20	0.77
22	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,570,000,000	100.36 3,582,910,000	100.25 3,578,925,000	0.1 2026/9/20	0.77
23	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,550,000,000	99.80 3,542,900,000	99.95 3,548,438,000	0.1 2027/12/20	0.76
24	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	3,520,000,000	100.35 3,532,488,000	100.26 3,529,257,600	0.1 2026/3/20	0.76

25	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	97.99 3,527,640,000	97.77 3,519,972,000	0.1 2030/12/20	0.76
26	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,630,000,000	97.21 3,528,723,000	96.85 3,515,945,400	0.1 2031/12/20	0.76
27	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,570,000,000	97.62 3,485,034,000	97.29 3,473,502,900	0.1 2031/6/20	0.75
28	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,410,000,000	100.79 3,436,939,000	100.67 3,432,881,100	0.5 2024/9/20	0.74
29	149回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,380,000,000	100.06 3,382,298,000	99.95 3,378,377,600	0.005 2026/9/20	0.73
30	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,340,000,000	101.11 3,377,118,400	100.88 3,369,625,800	0.4 2025/9/20	0.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,222,400	1,896.32 13,695,991,310	2,386.00 17,232,646,400	— —	3.87
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	930,400	12,038.97 11,201,060,660	13,315.00 12,388,276,000	— —	2.78
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,113,000	933.17 7,570,847,895	1,146.00 9,297,498,000	— —	2.09
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	131,600	61,162.40 8,048,972,935	63,760.00 8,390,816,000	— —	1.88
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	42,258,400	154.78 6,540,902,793	162.90 6,883,893,360	— —	1.55

6	三菱商事 日本	株式 卸売業	848,500	4,625.78 3,924,975,200	7,265.00 6,164,352,500	— —	1.38
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	920,700	5,622.33 5,176,482,141	6,694.00 6,163,165,800	— —	1.38
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	646,000	7,057.14 4,558,915,453	9,298.00 6,006,508,000	— —	1.35
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	278,400	15,624.81 4,349,947,981	21,245.00 5,914,608,000	— —	1.33
10	三井物産 日本	株式 卸売業	987,600	3,933.85 3,885,074,565	5,541.00 5,472,291,600	— —	1.23
11	任天堂 日本	株式 その他製品	830,400	5,598.37 4,648,893,560	6,450.00 5,356,080,000	— —	1.20
12	信越化学工業 日本	株式 化学	1,095,200	3,874.40 4,243,251,807	4,679.00 5,124,440,800	— —	1.15
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,167,500	4,197.71 4,900,832,073	4,341.00 5,068,117,500	— —	1.14
14	第一三共 日本	株式 医薬品	1,149,200	4,128.00 4,743,905,686	4,347.00 4,995,572,400	— —	1.12
15	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,001,000	4,273.35 4,277,626,981	4,933.00 4,937,933,000	— —	1.11
16	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	857,500	4,084.33 3,502,316,239	5,750.00 4,930,625,000	— —	1.11
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,069,200	3,299.16 3,527,463,119	4,513.00 4,825,299,600	— —	1.08
18	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	650,700	6,165.49 4,011,887,771	7,242.00 4,712,369,400	— —	1.06
19	HOYA 日本	株式 精密機器	278,700	14,248.46 3,971,046,437	16,530.00 4,606,911,000	— —	1.03
20	ダイキン工業 日本	株式 機械	158,600	23,012.64 3,649,805,550	28,690.00 4,550,234,000	— —	1.02
21	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,873,500	2,068.05 3,874,501,363	2,404.00 4,503,894,000	— —	1.01
22	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,019,400	3,979.10 4,056,301,084	4,187.00 4,268,227,800	— —	0.96
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,280,500	2,721.16 3,484,455,422	3,259.00 4,173,149,500	— —	0.94
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	715,600	4,347.10 3,110,786,535	5,450.00 3,900,020,000	— —	0.88
25	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,120,300	1,529.44 3,242,873,300	1,578.00 3,345,833,400	— —	0.75
26	村田製作所 日本	株式	398,900	7,722.21	8,325.00	—	0.75

		日本	電気機器		3,080,390,194	3,320,842,500	—	
27	SMC		株式		68,001.90	74,150.00	—	0.72
		日本	機械	43,100	2,930,882,070	3,195,865,000	—	
28	セブン&アイ・ホールディングス		株式		5,948.12	5,893.00	—	0.63
		日本	小売業	479,600	2,852,721,959	2,826,282,800	—	
29	三菱電機		株式		1,514.05	2,051.00	—	0.63
		日本	電気機器	1,373,000	2,078,800,490	2,816,023,000	—	
30	ファナック		株式		4,622.76	4,348.00	—	0.63
		日本	電気機器	641,400	2,965,038,536	2,788,807,200	—	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	97.52
合計	97.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2023年7月31日現在

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



繊維製品		0.42
鉱業		0.32
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業		0.08
合計		97.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,502,740,200	81.41 1,223,394,752	81.40 1,223,265,745	1.25 2031/8/15	0.53
2	US T N/B 1.5 11/30/24 アメリカ	国債証 券	1,268,730,000	94.46 1,198,467,732	95.19 1,207,821,051	1.5 2024/11/30	0.52
3	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証 券	1,071,372,000	103.19 1,105,606,670	101.07 1,082,922,726	4.125 2032/11/15	0.47
4	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,134,808,500	92.10 1,045,165,328	91.81 1,041,896,054	2.875 2032/5/15	0.45
5	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	1,253,223,300	81.59 1,022,534,564	81.74 1,024,412,144	1.125 2031/2/15	0.44
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証 券	1,239,126,300	82.07 1,017,013,843	81.76 1,013,227,761	1.375 2031/11/15	0.44
7	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証 券	1,105,204,800	91.93 1,016,079,420	90.72 1,002,714,316	2.75 2032/8/15	0.44
8	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	1,237,716,600	80.53 996,753,759	80.50 996,458,551	0.875 2030/11/15	0.43
9	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	1,167,231,600	85.39 996,783,271	84.87 990,687,820	1.875 2032/2/15	0.43
10	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	1,161,592,800	84.64 983,269,974	84.37 980,048,550	1.625 2031/5/15	0.43
11	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証 券	976,050,900	99.64 972,594,595	100.21 978,107,927	2.26 2025/2/24	0.42
12	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	1,161,592,800	79.49 923,358,331	79.25 920,562,294	0.625 2030/8/15	0.40
13	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証 券	991,019,100	91.47 906,567,302	91.53 907,150,230	1.5 2026/8/15	0.39
14	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証 券	845,820,000	98.93 836,851,488	97.82 827,449,846	3.75 2026/4/15	0.36
15	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証 券	788,728,000	101.64 801,688,279	102.25 806,495,123	3.03 2026/3/11	0.35
16	US T N/B 3.875 01/15/26 アメリカ	国債証 券	817,626,000	98.44 804,928,268	98.08 801,992,098	3.875 2026/1/15	0.35
17	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証 券	900,798,300	86.43 778,607,627	87.11 784,714,953	1.125 2028/2/29	0.34
18	US T N/B 4.25 12/31/24 アメリカ	国債証 券	775,335,000	99.03 767,876,277	98.67 765,037,581	4.25 2024/12/31	0.33

19	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	835,783,000	90.39 755,498,803	90.58 757,068,121	1.5 2031/5/25	0.33
20	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証 券	806,348,400	90.88 732,812,279	90.50 729,808,291	0.75 2026/3/31	0.32
21	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証 券	803,529,000	89.75 721,170,096	89.97 722,987,768	0.375 2026/1/31	0.31
22	US T N/B 1.375 12/31/28 アメリカ	国債証 券	831,723,000	87.89 731,009,475	86.59 720,236,377	1.375 2028/12/31	0.31
23	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証 券	793,838,500	90.07 715,040,502	90.56 718,903,320	0.75 2028/5/25	0.31
24	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証 券	793,661,100	89.53 710,567,478	89.96 714,046,970	0.75 2026/5/31	0.31
25	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証 券	706,842,500	98.19 694,057,132	97.91 692,076,120	2.5 2030/5/25	0.30
26	US T N/B 4.0 11/15/52 アメリカ	国債証 券	685,114,200	101.44 695,025,200	99.74 683,347,891	4 2052/11/15	0.30
27	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	721,766,400	94.71 683,604,498	94.56 682,562,637	2.25 2025/11/15	0.30
28	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	704,850,000	98.35 693,284,821	96.29 678,748,523	3.5 2033/2/15	0.29
29	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証 券	681,986,500	99.74 680,237,187	99.44 678,206,587	2.75 2027/10/25	0.29
30	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証 券	728,814,900	92.21 672,092,183	92.36 673,200,059	1.625 2026/5/15	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.72
合計	98.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,218,193	21,883.25 48,541,288,098	27,606.15 61,235,779,999	— —	5.55
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	991,596	38,754.61 38,428,918,552	47,700.01 47,299,147,941	— —	4.28
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小	1,295,404	14,212.13 18,410,461,259	18,637.64 24,143,278,199	— —	2.19

		売り					
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	346,525	34,051.59 11,799,729,744	65,903.47 22,837,201,674	— —	2.07
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	835,893	13,602.06 11,369,870,365	18,689.80 15,622,675,164	— —	1.42
6	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	400,442	29,423.58 11,782,439,815	37,560.04 15,040,620,260	— —	1.36
7	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	309,915	26,065.69 8,078,148,880	45,882.91 14,219,803,788	— —	1.29
8	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	753,544	13,561.12 10,218,906,151	18,750.41 14,129,266,262	— —	1.28
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイダー ／ヘルス ケア・ サービス	130,719	69,362.17 9,066,953,780	70,895.22 9,267,352,616	— —	0.84
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	410,128	20,036.29 8,217,446,884	22,119.60 9,071,868,416	— —	0.82
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	182,353	43,942.63 8,013,071,561	49,312.71 8,992,321,646	— —	0.81
12	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	363,483	22,736.03 8,264,161,455	24,596.44 8,940,389,836	— —	0.81
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	567,794	16,355.45 9,286,531,769	14,683.43 8,337,166,405	— —	0.76
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	227,383	32,302.46 7,345,031,728	33,233.67 7,556,773,290	— —	0.68
15	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・	58,337	86,467.43 5,044,250,702	126,843.39 7,399,663,209	— —	0.67

		半導体製造装置					
16	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	113,132	49,385.07 5,587,032,181	64,631.92 7,311,939,006	— —	0.66
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	330,357	19,799.00 6,540,741,177	22,049.11 7,284,080,376	— —	0.66
18	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	384,822	17,994.14 6,924,544,603	17,392.31 6,692,947,367	— —	0.61
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	141,711	44,435.39 6,296,983,673	46,713.22 6,619,778,380	— —	0.60
20	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	119,102	52,104.14 6,205,707,463	55,395.57 6,597,723,321	— —	0.60
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	56,393	96,440.42 5,438,564,688	101,443.54 5,720,706,115	— —	0.52
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	251,757	24,182.87 6,088,208,851	22,395.90 5,638,325,578	— —	0.51
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	355,630	15,348.01 5,458,214,621	14,990.74 5,331,160,351	— —	0.48
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	247,235	21,547.06 5,327,188,135	21,265.32 5,257,532,502	— —	0.48
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	192,695	24,898.29 4,797,776,008	26,828.00 5,169,621,594	— —	0.47
26	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	232,050	21,018.94 4,877,446,948	22,034.28 5,113,054,674	— —	0.46
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	574,262	8,441.07 4,847,389,144	8,807.80 5,057,988,059	— —	0.46
28	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・アパレル・贅沢品	38,691	126,527.67 4,895,482,082	130,680.41 5,056,156,130	— —	0.46
29	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	62,083	70,871.85 4,399,937,302	79,411.22 4,930,086,796	— —	0.45
30	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	64,328	53,392.47 3,434,631,318	74,554.80 4,795,961,425	— —	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)

株式	96.30
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.84
合計	98.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
ソフトウェア	外国	7.95
半導体・半導体製造装置		6.14
コンピュータ・周辺機器		5.75
銀行		5.39
医薬品		4.99
石油・ガス・消耗燃料		4.50
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.11
資本市場		3.05
金融サービス		3.03
保険		2.97
大規模小売り		2.61
ヘルスケア機器・用品		2.36
ホテル・レストラン・レジャー		2.09
自動車		2.07
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.06
化学		1.94
機械		1.85
バイオテクノロジー		1.84
飲料		1.73
生活必需品流通・小売り		1.71
電力		1.69
航空宇宙・防衛		1.63
専門小売り		1.62
食品		1.57
金属・鉱業		1.51
繊維・アパレル・贅沢品		1.33
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.31
情報技術サービス		1.26
娯楽		1.10
家庭用品		1.08
陸上運輸		1.08
専門サービス		1.00
各種電気通信サービス		0.91
コングロマリット		0.90
電気設備		0.84
総合公益事業		0.77
メディア		0.71
通信機器		0.63
建設関連製品		0.62
タバコ		0.59
パーソナルケア用品		0.59

航空貨物・物流サービス	0.58
商業サービス・用品	0.52
電子装置・機器・部品	0.51
商社・流通業	0.42
不動産管理・開発	0.36
消費者金融	0.36
家庭用耐久財	0.30
建設・土木	0.30
建設資材	0.29
エネルギー設備・サービス	0.28
無線通信サービス	0.23
容器・包装	0.22
自動車用部品	0.19
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13
ガス	0.12
運送インフラ	0.11
販売	0.10
水道	0.10
紙製品・林産品	0.09
海上運輸	0.07
旅客航空輸送	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	96.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	2,537,460,000	100.66 2,554,270,672	97.81 2,481,930,225	4.375 2029/4/16	1.97
2	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	2,396,490,000	95.29 2,283,723,139	95.10 2,279,077,639	5.5 2029/2/22	1.81
3	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,973,580,000	106.56 2,103,087,729	107.30 2,117,744,098	7.125 2033/1/17	1.68
4	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	2,114,550,000	89.23 1,887,004,684	90.37 1,910,961,126	4.85 2029/9/30	1.52
5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	1,973,580,000	98.35 1,941,110,379	96.24 1,899,462,203	4.817 2049/3/14	1.51
6	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	2,396,490,000	76.77 1,839,981,741	79.16 1,897,243,209	5.875 2060/1/30	1.51
7	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	2,537,460,000	71.87	74.64	5.75	1.50

	南アフリカ			1,823,902,283	1,893,960,144	2049/9/30	
8	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証 券	1,832,610,000	100.01 1,832,868,874	97.91 1,794,370,521	4.375 2031/1/23	1.43
9	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証 券	1,973,580,000	93.74 1,850,033,892	90.35 1,783,129,530	4.4 2050/4/16	1.42
10	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証 券	1,832,610,000	98.00 1,795,957,800	97.06 1,778,731,266	3.4 2025/4/16	1.41
11	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証 券	1,832,610,000	95.89 1,757,453,795	95.42 1,748,828,531	2.875 2025/6/6	1.39
12	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証 券	1,691,640,000	101.90 1,723,867,574	101.20 1,712,002,270	6 2029/8/1	1.36
13	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証 券	1,832,610,000	89.38 1,638,001,020	89.69 1,643,698,953	3.875 2030/6/12	1.31
14	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証 券	2,114,550,000	73.29 1,549,905,540	76.47 1,617,073,777	4.75 2050/1/14	1.28
15	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証 券	1,550,670,000	102.56 1,590,405,213	102.12 1,583,544,204	6.25 2032/9/22	1.26
16	ROMANIA 4.0 02/14/51 ルーマニア	国債証 券	2,114,550,000	69.71 1,474,140,911	72.37 1,530,352,698	4 2051/2/14	1.22
17	INDONESIA 3.85 10/15/30 インドネシア	国債証 券	1,607,058,000	95.75 1,538,825,231	94.12 1,512,659,235	3.85 2030/10/15	1.20
18	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証 券	1,578,864,000	92.54 1,461,102,807	94.17 1,486,931,643	6 2033/2/22	1.18
19	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25 サウジアラビア	国債証 券	1,550,670,000	96.74 1,500,174,546	95.21 1,476,392,907	2.9 2025/10/22	1.17
20	REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27 チリ	国債証 券	1,578,864,000	94.06 1,485,219,909	93.01 1,468,568,113	2.75 2027/1/31	1.17
21	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証 券	1,691,640,000	85.72 1,450,175,940	84.97 1,437,541,648	2.783 2031/1/23	1.14
22	HUNGARY 6.125 05/22/28 ハンガリー	国債証 券	1,409,700,000	102.46 1,444,491,396	101.72 1,433,952,478	6.125 2028/5/22	1.14
23	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28 サウジアラビア	国債証 券	1,409,700,000	102.07 1,438,916,032	99.43 1,401,711,230	4.75 2028/1/18	1.11
24	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証 券	1,409,700,000	97.82 1,379,031,842	98.02 1,381,827,411	5.25 2029/6/16	1.10
25	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証 券	1,409,700,000	97.51 1,374,639,700	97.03 1,367,852,082	4.5 2029/4/22	1.09
26	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証 券	1,409,700,000	96.35 1,358,329,122	96.28 1,357,342,332	2.125 2024/9/30	1.08
27	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	国債証 券	1,409,700,000	98.73	96.12	3.75	1.08

	カテゴリー			1,391,926,502	1,355,067,076	2030/4/16	
28	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,409,700,000	96.56	95.51	2.5	1.07
				1,361,206,320	1,346,404,470	2025/4/16	
29	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,268,730,000	105.75	105.18	6.35	1.06
				1,341,724,270	1,334,454,819	2035/2/9	
30	COLOMBIA 7.5 02/02/34 コロンビア	国債証券	1,268,730,000	96.81	100.79	7.5	1.02
				1,228,324,679	1,278,819,879	2034/2/2	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.48
合計	97.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

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



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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2023年7月31日現在

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

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### D I A Mマナーマザーファンド

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	4 3 5回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	100.13 100,130,000	100.08 100,080,000	0.005 2024/4/1	20.55
2	4 3 0回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	100.07 100,074,000	100.03 100,031,000	0.005 2023/11/1	20.54
3	4 2 9回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	100.07 100,070,000	100.02 100,025,000	0.005 2023/10/1	20.53

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	61.62
合計	61.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### ②【投資不動産物件】

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。

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。

D I A Mマネーマザーファンド  
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7月31日現在

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

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

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

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7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep23	買建	447	14,238,937,406	14,513,605,116	1.31
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep23	買建	413	2,817,287,785	2,883,971,772	0.26
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep23	買建	60	819,631,926	835,458,840	0.08
	モン トリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep23	買建	25	649,431,140	656,117,800	0.06
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Sep23	買建	23	390,572,928	397,476,639	0.04

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

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

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7月31日現在

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

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

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

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

D I A Mマネーマザーファンド

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### ① 【純資産の推移】

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第4計算期間末 (2014年1月14日)	836	836	1.1801	1.1801
第5計算期間末 (2014年7月11日)	4,833	4,833	1.1888	1.1888
第6計算期間末 (2015年1月13日)	7,664	7,664	1.2660	1.2660
第7計算期間末 (2015年7月13日)	16,373	16,373	1.2816	1.2816
第8計算期間末 (2016年1月12日)	29,373	29,373	1.2200	1.2200
第9計算期間末 (2016年7月11日)	30,524	30,524	1.1796	1.1796
第10計算期間末 (2017年1月11日)	33,083	33,083	1.2331	1.2331
第11計算期間末 (2017年7月11日)	32,461	32,461	1.2524	1.2524
第12計算期間末 (2018年1月11日)	28,678	28,678	1.2864	1.2864
第13計算期間末 (2018年7月11日)	27,026	27,026	1.2537	1.2537
第14計算期間末 (2019年1月11日)	24,449	24,449	1.2062	1.2062
第15計算期間末 (2019年7月11日)	22,938	22,938	1.2287	1.2287
第16計算期間末 (2020年1月14日)	20,607	20,607	1.2590	1.2590
第17計算期間末 (2020年7月13日)	18,748	18,748	1.2562	1.2562
第18計算期間末 (2021年1月12日)	16,160	16,160	1.2941	1.2941
第19計算期間末 (2021年7月12日)	13,725	13,725	1.3111	1.3111

第20計算期間末 (2022年1月11日)	12,268	12,268	1.2898	1.2898
第21計算期間末 (2022年7月11日)	11,212	11,212	1.2429	1.2429
第22計算期間末 (2023年1月11日)	10,436	10,436	1.1999	1.1999
第23計算期間末 (2023年7月11日)	10,240	10,240	1.2573	1.2573
2022年7月末日	11,212	—	1.2483	—
8月末日	11,153	—	1.2474	—
9月末日	10,854	—	1.2213	—
10月末日	10,933	—	1.2366	—
11月末日	10,836	—	1.2325	—
12月末日	10,439	—	1.1988	—
2023年1月末日	10,404	—	1.2046	—
2月末日	10,369	—	1.2086	—
3月末日	10,280	—	1.2068	—
4月末日	10,276	—	1.2118	—
5月末日	10,336	—	1.2336	—
6月末日	10,576	—	1.2858	—
7月末日	10,259	—	1.2713	—

## ②【分配の推移】

	1口当たりの分配金 (円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000

## ③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第4計算期間	2.6
第5計算期間	0.7

第6計算期間	6.5
第7計算期間	1.2
第8計算期間	△4.8
第9計算期間	△3.3
第10計算期間	4.5
第11計算期間	1.6
第12計算期間	2.7
第13計算期間	△2.5
第14計算期間	△3.8
第15計算期間	1.9
第16計算期間	2.5
第17計算期間	△0.2
第18計算期間	3.0
第19計算期間	1.3
第20計算期間	△1.6
第21計算期間	△3.6
第22計算期間	△3.5
第23計算期間	4.8

(注) 収益率は期間騰落率です。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

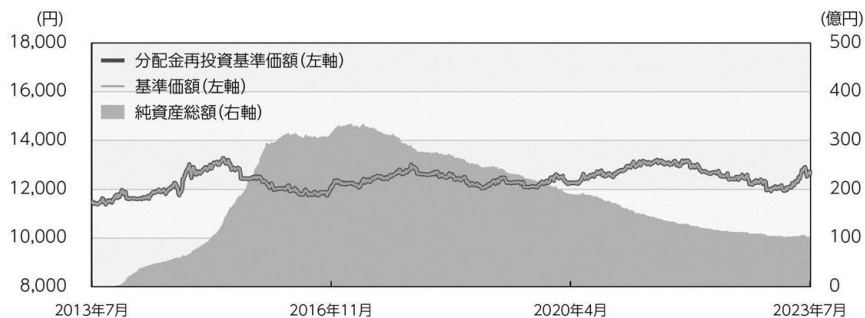
	設定口数	解約口数
第4計算期間	719,575,072	60,468,768
第5計算期間	3,546,694,011	190,033,935
第6計算期間	3,178,106,719	1,190,093,443
第7計算期間	8,113,284,548	1,391,102,184
第8計算期間	12,475,200,872	1,174,643,755
第9計算期間	4,218,169,651	2,417,079,166
第10計算期間	3,726,999,882	2,774,409,766
第11計算期間	2,943,838,417	3,853,950,424
第12計算期間	2,426,808,751	6,053,103,346
第13計算期間	2,339,206,033	3,075,836,809
第14計算期間	967,336,189	2,254,647,937
第15計算期間	639,297,067	2,240,826,501
第16計算期間	513,000,084	2,813,656,675
第17計算期間	306,020,884	1,748,348,178
第18計算期間	306,787,422	2,744,453,780
第19計算期間	269,416,421	2,288,470,279
第20計算期間	328,483,921	1,285,084,124
第21計算期間	196,469,949	687,342,399
第22計算期間	156,928,133	479,916,329
第23計算期間	153,313,399	706,379,922

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。



データの基準日:2023年7月31日

**基準価額・純資産の推移** (2013年7月31日~2023年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
 (設定日:2012年10月26日)

**分配の推移(税引前)**

2021年 7月	0円
2022年 1月	0円
2022年 7月	0円
2023年 1月	0円
2023年 7月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

**主要な資産の状況**

■ **組入銘柄** ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.16
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	14.59
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.86
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	7.42
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.28
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.12
7	DIAMマネーマザーファンド	2.89

■ **国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド**

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

組入上位5銘柄

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

■ **国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド**

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

組入上位5銘柄

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

■ **外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド**

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.53
2	US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	アメリカ	1.5	2024/11/30	0.52
3	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.47
4	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	0.45
5	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.44

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

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

### ■エマーシング債券パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

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

### ■エマーシング株式パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	5.98
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.76
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.55
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.74
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.42

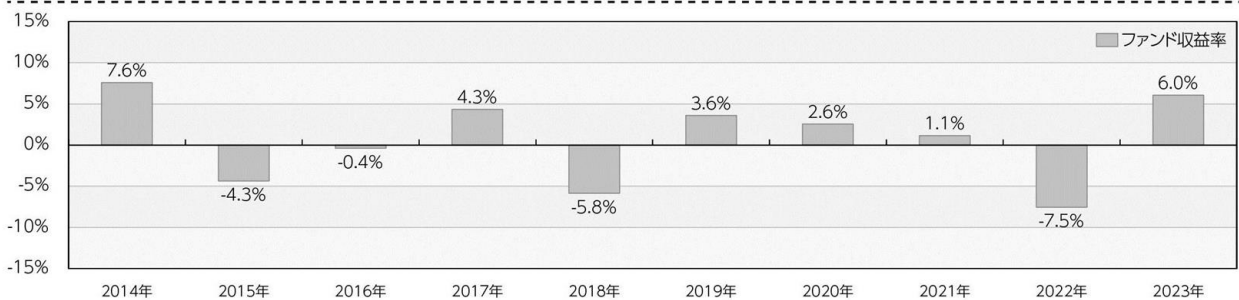
### ■DIAMマネーマザーファンド

※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。

#### 組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	435回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2024/4/1	20.55
2	430回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2023/11/1	20.54
3	429回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2023/10/1	20.53

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 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。

当ファンドでは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」に従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、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、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、追加信託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、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当たりに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、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、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經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。

※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、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日※における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

信託期間は、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

#### (4) 【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。

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

り次の計算期間が開始されるものとします。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も同様とします。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払わ

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

#### ロ. 信託約款の変更等

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

#### ハ. 関係法人との契約の更改



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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、信託終了日まで存続します。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1月11日、7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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

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

### ②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

③一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、解約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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間（2023年1月12日から2023年7月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2023年9月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているクルーズコントロールの2023年1月12日から2023年7月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、クルーズコントロールの2023年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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】

## 【クルーズコントロール】

### (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 2023年1月11日現在	第23期 2023年7月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,445,951,514	218,901,719
親投資信託受益証券	2,079,310,161	10,119,213,890
流動資産合計	10,525,261,675	10,338,115,609
資産合計	10,525,261,675	10,338,115,609
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,293,032	17,813,794
未払受託者報酬	3,031,664	2,826,537
未払委託者報酬	81,856,172	76,317,709
その他未払費用	215,759	201,159
流動負債合計	88,396,627	97,159,199
負債合計	88,396,627	97,159,199
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,698,156,228	8,145,089,705
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,738,708,820	2,095,866,705
(分配準備積立金)	526,970,356	551,376,251
元本等合計	10,436,865,048	10,240,956,410
純資産合計	10,436,865,048	10,240,956,410
負債純資産合計	10,525,261,675	10,338,115,609

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期		第23期	
	自	2022年7月12日 至 2023年1月11日	自	2023年1月12日 至 2023年7月11日
営業収益				
受取利息		25,819		8,232
有価証券売買等損益		△291,605,090		567,903,729
営業収益合計		△291,579,271		567,911,961
営業費用				
支払利息		836,144		332,973
受託者報酬		3,031,664		2,826,537
委託者報酬		81,856,172		76,317,709
その他費用		221,700		201,159
営業費用合計		85,945,680		79,678,378
営業利益又は営業損失(△)		△377,524,951		488,233,583
経常利益又は経常損失(△)		△377,524,951		488,233,583
当期純利益又は当期純損失(△)		△377,524,951		488,233,583
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(△)		△4,709,400		24,263,745
期首剰余金又は期首欠損金(△)		2,191,333,820		1,738,708,820
剰余金増加額又は欠損金減少額		36,758,653		34,481,012
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		—		—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		36,758,653		34,481,012
剰余金減少額又は欠損金増加額		116,568,102		141,292,965
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		116,568,102		141,292,965
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		—		—
分配金		—		—
期末剰余金又は期末欠損金(△)		1,738,708,820		2,095,866,705

(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23期	
	自 2023年1月12日	至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第22期	第23期
	2023年1月11日現在	2023年7月11日現在
1. 期首元本額	9,021,144,424円	8,698,156,228円
期中追加設定元本額	156,928,133円	153,313,399円
期中一部解約元本額	479,916,329円	706,379,922円
2. 受益権の総数	8,698,156,228口	8,145,089,705口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第22期	第23期
	自 2022年7月12日 至 2023年1月11日	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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(2,206,382,591円)及び分配準備積立金(526,970,356円)より分配対象収益は2,733,352,947円(1万口当たり3,142.45円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(66,774,384円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,075,060,881円)及び分配準備積立金(484,601,867円)より分配対象収益は2,626,437,132円(1万口当たり3,224.56円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第22期	第23期
	自 2022年7月12日 至 2023年1月11日	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替	同左



3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p>	同左
-------------------	---	----

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期 2023年1月11日現在	第23期 2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第22期 2023年1月11日現在	第23期 2023年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	△21,769,842	552,248,524
合計	△21,769,842	552,248,524

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第22期 2023年1月11日現在	第23期 2023年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,199円 (11,999円)	1,257円 (12,573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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	536,916,590	2,072,014,812	
	国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	1,473,088,109	1,862,130,678	
	D I A Mマネーマザーファンド	294,245,101	296,039,996	
	外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	149,133,786	1,042,519,731	
	外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	1,346,975,128	2,885,894,211	
	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	670,209,941	992,379,859	
	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	458,878,959	968,234,603	
親投資信託受益証券 合計		4,929,447,614	10,119,213,890	
合計			10,119,213,890	

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

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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、「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、「エマージング株式

パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「D I A Mマネーマザーファンド」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7月11日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日
	至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあつては、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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

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

D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,140,169,962円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	427,959,915円
投資のソムリエ	100,007,028,908円
クルーズコントロール	1,473,088,109円
投資のソムリエ<DC年金>	8,156,425,983円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,922,360,410円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,610,527,393円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,509,499,603円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	36,245,246,105円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	325,435,388円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	161,050,796円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	68,610,618円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,403,102,512円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,889,614,154円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	13,760,509,960円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,733,653,831円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	391,387,265円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	178,007,365円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	109,773,915円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,593,674,865円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	25,283,549円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	136,995,068円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,149,833,834円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,177,214,557円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,527,601,112円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	714,139,873円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,129,000,572円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	2,919,890,148円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,944,005,150円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,020,368,340円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	1,991,923,654円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,205,345,851円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,294,012,068円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,734,251,606円
A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	583,116,810円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	270,703,526円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	4,665,654,869円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII(適格機関投資家限定)	4,676,992,168円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV(適格機関投資家限定)	4,633,549,045円

インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,913,787,731円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	39,571,285円
AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	911,099,189円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	149,937,203円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	102,304,568円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	20,538,088円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	59,289,077円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	29,114,755円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	352,199円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	7,662,596円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	91,500,530円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2,925,850,535円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,163,394,059円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,289,697,515円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	56,761,364円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	140,772,178円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	1,703,211,929円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	105,654,328円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	546,725円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	1,898,420,501円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	45,363,393円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	282,510,892円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	435,928,036円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	782,523,327円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	202,244,313円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	96,924,285円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	748,262,131円
動的パッケージファンド<DC年金>	354,152,701円
コア資産形成ファンド	224,442,207円
MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	21,026,997,285円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	43,582,617,718円
MHAM日本債券パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	11,303,032,417円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド〔適格機関投資家限定〕	656,991,231円
計	451,050,455,847円
2. 受益権の総数	451,050,455,847口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	3,887,798,150
地方債証券	333,628,540
特殊債券	443,754,484
社債券	278,372,110
合計	4,943,553,284

(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7月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在



1口当たり純資産額	1.2641円
(1万口当たり純資産額)	(12,641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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 3 9回 利付国庫債券 (2年)	1,300,000,000	1,301,716,000	
	4 4 0回 利付国庫債券 (2年)	1,700,000,000	1,702,414,000	
	4 4 1回 利付国庫債券 (2年)	1,100,000,000	1,101,606,000	
	4 4 2回 利付国庫債券 (2年)	1,500,000,000	1,502,250,000	
	4 4 3回 利付国庫債券 (2年)	2,200,000,000	2,203,212,000	
	4 4 4回 利付国庫債券 (2年)	1,400,000,000	1,401,960,000	
	4 4 5回 利付国庫債券 (2年)	2,400,000,000	2,403,168,000	
	4 4 6回 利付国庫債券 (2年)	1,900,000,000	1,902,318,000	
	4 4 7回 利付国庫債券 (2年)	1,600,000,000	1,601,776,000	
	4 4 8回 利付国庫債券 (2年)	2,000,000,000	2,002,160,000	
	1 4 1回 利付国庫債券 (5年)	3,710,000,000	3,719,275,000	
	1 4 2回 利付国庫債券 (5年)	2,930,000,000	2,938,028,200	
	1 4 3回 利付国庫債券 (5年)	3,700,000,000	3,710,286,000	
	1 4 4回 利付国庫債券 (5年)	4,530,000,000	4,544,043,000	
	1 4 5回 利付国庫債券 (5年)	4,250,000,000	4,264,450,000	
	1 4 6回 利付国庫債券 (5年)	3,900,000,000	3,914,274,000	
	1 4 7回 利付国庫債券 (5年)	3,250,000,000	3,254,355,000	
	1 4 8回 利付国庫債券 (5年)	3,510,000,000	3,514,106,700	
	1 4 9回 利付国庫債券 (5年)	5,010,000,000	5,014,759,500	
	1 5 0回 利付国庫債券 (5年)	4,220,000,000	4,222,869,600	

年)			
1 5 1回 利付国庫債券 (5年)	2,700,000,000	2,700,486,000	
1 5 2回 利付国庫債券 (5年)	2,530,000,000	2,539,310,400	
1 5 3回 利付国庫債券 (5年)	4,110,000,000	4,108,356,000	
1 5 4回 利付国庫債券 (5年)	5,000,000,000	5,013,600,000	
1 5 5回 利付国庫債券 (5年)	1,800,000,000	1,819,530,000	
1 5 6回 利付国庫債券 (5年)	3,400,000,000	3,421,080,000	
1 5 7回 利付国庫債券 (5年)	1,900,000,000	1,910,184,000	
1 5 8回 利付国庫債券 (5年)	2,800,000,000	2,800,644,000	
1回 利付国庫債券 (40年)	110,000,000	138,165,500	
2回 利付国庫債券 (40年)	330,000,000	399,897,300	
3回 利付国庫債券 (40年)	540,000,000	654,447,600	
4回 利付国庫債券 (40年)	720,000,000	874,173,600	
5回 利付国庫債券 (40年)	710,000,000	832,098,700	
6回 利付国庫債券 (40年)	1,240,000,000	1,425,318,000	
7回 利付国庫債券 (40年)	1,210,000,000	1,330,758,000	
8回 利付国庫債券 (40年)	1,090,000,000	1,113,206,100	
9回 利付国庫債券 (40年)	2,150,000,000	1,622,368,500	
10回 利付国庫債券 (40年)	1,970,000,000	1,736,555,000	
11回 利付国庫債券 (40年)	1,580,000,000	1,341,420,000	
12回 利付国庫債券 (40年)	1,440,000,000	1,092,571,200	
13回 利付国庫債券 (40年)	2,190,000,000	1,646,398,200	
14回 利付国庫債券 (40年)	2,120,000,000	1,699,370,800	
15回 利付国庫債券 (40年)	2,340,000,000	2,063,669,400	
16回 利付国庫債券 (40年)	300,000,000	288,663,000	
3 3 5回 利付国庫債券 (10年)	9,410,000,000	9,478,410,700	

3 3 6回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,008,510,000	
3 3 7回 利付国庫債券（10年）	2,300,000,000	2,312,926,000	
3 3 8回 利付国庫債券（10年）	6,230,000,000	6,278,905,500	
3 3 9回 利付国庫債券（10年）	6,480,000,000	6,537,866,400	
3 4 0回 利付国庫債券（10年）	3,340,000,000	3,373,333,200	
3 4 1回 利付国庫債券（10年）	6,620,000,000	6,676,601,000	
3 4 2回 利付国庫債券（10年）	3,520,000,000	3,533,728,000	
3 4 3回 利付国庫債券（10年）	4,090,000,000	4,106,237,300	
3 4 4回 利付国庫債券（10年）	5,270,000,000	5,291,027,300	
3 4 5回 利付国庫債券（10年）	4,740,000,000	4,758,723,000	
3 4 6回 利付国庫債券（10年）	4,390,000,000	4,406,155,200	
3 4 7回 利付国庫債券（10年）	5,930,000,000	5,949,806,200	
3 4 8回 利付国庫債券（10年）	4,070,000,000	4,081,070,400	
3 4 9回 利付国庫債券（10年）	4,950,000,000	4,959,850,500	
3 5 0回 利付国庫債券（10年）	5,560,000,000	5,563,892,000	
3 5 1回 利付国庫債券（10年）	4,680,000,000	4,676,536,800	
3 5 2回 利付国庫債券（10年）	4,860,000,000	4,849,939,800	
3 5 3回 利付国庫債券（10年）	4,910,000,000	4,895,417,300	
3 5 4回 利付国庫債券（10年）	5,200,000,000	5,178,004,000	
3 5 5回 利付国庫債券（10年）	4,030,000,000	4,008,681,300	
3 5 6回 利付国庫債券（10年）	4,300,000,000	4,272,394,000	
3 5 7回 利付国庫債券（10年）	4,320,000,000	4,285,699,200	
3 5 8回 利付国庫債券（10年）	5,350,000,000	5,300,673,000	
3 5 9回 利付国庫債券（10年）	4,870,000,000	4,818,524,100	
3 6 0回 利付国庫債券（10年）	5,600,000,000	5,528,936,000	
3 6 1回 利付国庫債券（10年）	5,120,000,000	5,043,609,600	

0年)			
362回 利付国庫債券(10年)	4,610,000,000	4,532,183,200	
363回 利付国庫債券(10年)	4,870,000,000	4,777,762,200	
364回 利付国庫債券(10年)	4,250,000,000	4,160,410,000	
365回 利付国庫債券(10年)	3,630,000,000	3,546,836,700	
366回 利付国庫債券(10年)	4,280,000,000	4,211,648,400	
367回 利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,438,085,000	
368回 利付国庫債券(10年)	3,750,000,000	3,676,950,000	
369回 利付国庫債券(10年)	4,020,000,000	4,051,034,400	
370回 利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,319,932,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	127,569,200	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	114,205,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	237,952,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	233,392,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	279,862,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	266,719,500	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	172,582,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	405,745,800	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	313,448,200	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	289,951,200	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	323,937,900	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	476,348,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	333,776,800	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	401,685,900	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	370,794,100	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	354,545,300	

23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	428,305,500	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	396,570,900	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	753,535,600	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	763,573,400	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	950,788,300	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,052,081,000	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,064,720,800	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	861,408,000	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,176,406,300	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,376,316,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,438,032,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,237,433,400	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,599,557,200	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,563,374,400	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	961,061,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,721,565,000	
40回 利付国庫債券(30年)	1,330,000,000	1,502,434,500	
41回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,522,412,500	
42回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,467,061,200	
43回 利付国庫債券(30年)	1,350,000,000	1,500,619,500	
44回 利付国庫債券(30年)	1,490,000,000	1,656,447,900	
45回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,396,265,000	
46回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	1,900,626,000	
47回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,594,655,800	
48回 利付国庫債券(30年)	1,480,000,000	1,557,803,600	
49回 利付国庫債券(30年)	1,490,000,000	1,567,629,000	

年)			
5 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,760,000,000	1,640,302,400	
5 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,590,000,000	1,319,525,100	
5 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,530,000,000	1,327,259,700	
5 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,610,000,000	1,425,445,700	
5 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,550,000,000	1,432,990,500	
5 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,420,000,000	1,309,495,600	
5 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,460,000,000	1,342,951,800	
5 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,330,000,000	1,220,235,100	
5 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,840,000,000	1,683,784,000	
5 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	820,000,000	730,775,800	
6 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,400,000,000	1,303,624,000	
6 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,340,000,000	1,185,149,600	
6 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,020,000,000	854,627,400	
6 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,100,000,000	894,080,000	
6 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,330,000,000	1,077,167,000	
6 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,250,000,000	1,010,725,000	
6 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	990,000,000	796,880,700	
6 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,470,000,000	1,244,810,700	
6 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,470,000,000	1,240,827,000	
6 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,430,000,000	1,238,909,100	
7 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,610,000,000	1,393,455,000	
7 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,400,000,000	1,209,250,000	
7 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,390,000,000	1,199,375,400	
7 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,290,000,000	1,111,967,100	
7 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,620,000,000	1,510,552,800	

7 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 720, 000, 000	1, 725, 435, 200	
7 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 620, 000, 000	1, 663, 075, 800	
7 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 500, 000, 000	1, 612, 980, 000	
7 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 400, 000, 000	1, 437, 674, 000	
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	460, 000, 000	472, 130, 200	
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	380, 000, 000	391, 457, 000	
7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	40, 000, 000	41, 264, 000	
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	180, 000, 000	186, 582, 600	
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	70, 000, 000	72, 323, 300	
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	40, 000, 000	41, 395, 200	
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	250, 000, 000	259, 515, 000	
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	50, 000, 000	52, 000, 000	
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	90, 000, 000	93, 774, 600	
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	400, 000, 000	418, 036, 000	
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	140, 000, 000	146, 619, 200	
8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	70, 000, 000	73, 677, 800	
8 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	170, 000, 000	178, 517, 000	
8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	590, 000, 000	624, 054, 800	
8 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	120, 000, 000	127, 572, 000	
8 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	120, 000, 000	127, 249, 200	
8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	590, 000, 000	630, 538, 900	
8 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	10, 000, 000	10, 657, 700	
9 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	470, 000, 000	503, 402, 900	
9 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	110, 000, 000	118, 168, 600	
9 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 160, 000, 000	1, 244, 459, 600	
9 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	370, 000, 000	397, 287, 500	

年)			
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	721,884,800	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	599,478,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	129,850,800	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	719,802,600	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	173,828,800	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	817,942,500	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	911,962,500	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	254,858,400	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	556,250,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	177,214,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	120,753,600	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	704,832,000	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	553,230,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	663,144,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	755,163,600	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	384,216,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	487,973,200	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	514,606,600	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	823,494,200	
113回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,529,659,800	
114回 利付国庫債券(20年)	410,000,000	459,097,500	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	405,396,000	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	598,963,600	
117回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	528,059,100	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	621,672,150	



1 1 9回 利付国庫債券 (20年)	470,000,000	520,045,600	
1 2 1回 利付国庫債券 (20年)	640,000,000	713,843,200	
1 2 2回 利付国庫債券 (20年)	570,000,000	631,742,400	
1 2 3回 利付国庫債券 (20年)	350,000,000	396,287,500	
1 2 5回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	685,404,000	
1 2 6回 利付国庫債券 (20年)	510,000,000	574,933,200	
1 2 7回 利付国庫債券 (20年)	540,000,000	604,692,000	
1 2 8回 利付国庫債券 (20年)	370,000,000	415,103,000	
1 3 0回 利付国庫債券 (20年)	910,000,000	1,015,478,100	
1 3 2回 利付国庫債券 (20年)	30,000,000	33,293,100	
1 3 3回 利付国庫債券 (20年)	630,000,000	704,314,800	
1 3 4回 利付国庫債券 (20年)	200,000,000	224,072,000	
1 3 5回 利付国庫債券 (20年)	130,000,000	144,552,200	
1 3 6回 利付国庫債券 (20年)	360,000,000	397,270,800	
1 3 7回 利付国庫債券 (20年)	4,680,000,000	5,211,835,200	
1 3 8回 利付国庫債券 (20年)	4,420,000,000	4,845,911,200	
1 3 9回 利付国庫債券 (20年)	3,500,000,000	3,867,500,000	
1 4 0回 利付国庫債券 (20年)	2,850,000,000	3,179,887,500	
1 4 1回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,184,285,000	
1 4 2回 利付国庫債券 (20年)	430,000,000	484,326,200	
1 4 3回 利付国庫債券 (20年)	1,230,000,000	1,363,196,700	
1 4 4回 利付国庫債券 (20年)	750,000,000	824,250,000	
1 4 5回 利付国庫債券 (20年)	2,750,000,000	3,078,487,500	
1 4 6回 利付国庫債券 (20年)	2,740,000,000	3,069,265,800	
1 4 7回 利付国庫債券 (20年)	2,490,000,000	2,764,522,500	
1 4 8回 利付国庫債券 (20年)	2,360,000,000	2,596,778,800	

0年)			
149回 利付国庫債券 (20年)	2,840,000,000	3,123,233,200	
150回 利付国庫債券 (20年)	3,000,000,000	3,267,090,000	
151回 利付国庫債券 (20年)	3,060,000,000	3,265,295,400	
152回 利付国庫債券 (20年)	2,440,000,000	2,602,723,600	
153回 利付国庫債券 (20年)	2,800,000,000	3,016,692,000	
154回 利付国庫債券 (20年)	2,530,000,000	2,694,778,900	
155回 利付国庫債券 (20年)	2,380,000,000	2,477,294,400	
156回 利付国庫債券 (20年)	2,540,000,000	2,456,916,600	
157回 利付国庫債券 (20年)	2,460,000,000	2,311,317,600	
158回 利付国庫債券 (20年)	2,880,000,000	2,805,350,400	
159回 利付国庫債券 (20年)	2,640,000,000	2,597,971,200	
160回 利付国庫債券 (20年)	2,040,000,000	2,028,596,400	
161回 利付国庫債券 (20年)	2,040,000,000	1,997,588,400	
162回 利付国庫債券 (20年)	2,370,000,000	2,313,996,900	
163回 利付国庫債券 (20年)	2,140,000,000	2,084,574,000	
164回 利付国庫債券 (20年)	2,640,000,000	2,529,252,000	
165回 利付国庫債券 (20年)	1,850,000,000	1,767,675,000	
166回 利付国庫債券 (20年)	2,080,000,000	2,040,750,400	
167回 利付国庫債券 (20年)	2,350,000,000	2,231,630,500	
168回 利付国庫債券 (20年)	2,090,000,000	1,947,671,000	
169回 利付国庫債券 (20年)	2,260,000,000	2,065,210,600	
170回 利付国庫債券 (20年)	2,000,000,000	1,821,400,000	
171回 利付国庫債券 (20年)	1,640,000,000	1,488,398,400	
172回 利付国庫債券 (20年)	1,580,000,000	1,452,731,000	
173回 利付国庫債券 (20年)	2,520,000,000	2,309,328,000	

	174回 利付国庫債券(20年)	2,270,000,000	2,073,236,400	
	175回 利付国庫債券(20年)	2,130,000,000	1,971,826,200	
	176回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,030,094,000	
	177回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,762,644,000	
	178回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,744,371,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	2,450,000,000	2,243,538,500	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,140,000,000	2,062,853,000	
	181回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,055,102,000	
	182回 利付国庫債券(20年)	2,080,000,000	2,101,632,000	
	183回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,333,738,000	
	184回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,509,765,000	
国債証券 合計		478,355,000,000	481,079,691,350	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,793,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	109,785,500	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	196,006,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	392,564,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	293,520,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	229,964,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	115,150,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	103,456,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	104,564,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	213,746,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	321,159,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	110,638,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	111,407,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	209,758,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,859,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	399,056,000	
30年度14回 北海道公募	400,000,000	397,424,000		

公債			
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	97,359,000	
36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	244,185,000	
213回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,799,000	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	198,182,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	195,550,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	292,371,000	
3回 神奈川県公募公債 3 0年	100,000,000	121,977,000	
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	110,268,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	335,370,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	110,354,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,663,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,181,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	193,780,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	194,666,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	193,774,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	192,704,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	289,071,000	
10回 大阪府公募公債 2 0年	200,000,000	219,518,000	
13回 大阪府公募公債 2 0年	100,000,000	104,141,000	
14回 大阪府公募公債 2 0年	100,000,000	95,917,000	
190回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	298,656,000	
26年度11回 京都府公募 公債	350,000,000	352,198,000	
29年度13回 京都府公募 公債	109,330,000	109,198,804	
令和2年度1回 京都府公募 公債	400,000,000	392,504,000	
令和2年度14回 京都府公 募公債	200,000,000	195,782,000	
26年度17回 兵庫県公募 公債	200,000,000	201,286,000	

令和元年度 16回 兵庫県公募公債	200,000,000	195,888,000	
令和3年度 2回 兵庫県公募公債	100,000,000	97,418,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	119,496,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	209,386,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	315,093,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	103,878,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	102,108,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	196,128,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	97,774,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	194,676,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	104,958,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	105,266,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	205,336,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	104,596,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	331,233,000	
22年度 14回 愛知県公募公債	300,000,000	335,025,000	
24年度 12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	116,316,000	
26年度 4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	216,440,000	
27年度 8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	159,345,000	
27年度 15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,929,000	
30年度 19回 愛知県公募公債	200,000,000	197,642,000	
令和元年度 7回 愛知県公募公債	300,000,000	234,744,000	
30年度 3回 広島県公募公債	100,000,000	99,811,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	195,772,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	88,976,000	
令和2年 2回 広島県公募	100,000,000	90,476,000	

公債			
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	196,668,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	186,650,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	240,189,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	111,616,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	109,086,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	324,735,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	103,937,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	100,395,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	198,876,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	196,322,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	97,678,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	104,947,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	159,262,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	109,369,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	111,824,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	327,468,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	202,148,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,013,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	192,942,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	104,660,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	103,683,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	94,417,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	195,296,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	108,044,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,270,000	
144回 共同発行市場公募	400,000,000	402,756,000	

地方債			
146回 共同発行市場公募 地方債	600,000,000	605,406,000	
148回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	504,870,000	
150回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	302,847,000	
153回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	100,942,000	
157回 共同発行市場公募 地方債	120,000,000	119,966,400	
159回 共同発行市場公募 地方債	200,000,000	199,822,000	
160回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	499,240,000	
166回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	500,955,000	
169回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	501,255,000	
173回 共同発行市場公募 地方債	400,000,000	400,820,000	
174回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,876,000	
178回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	100,088,000	
179回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	500,440,000	
189回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,491,000	
194回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	296,055,000	
196回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	491,435,000	
203回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	97,963,000	
227回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	486,185,000	
228回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	483,995,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	99,359,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	100,652,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	195,158,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	100,660,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,438,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	199,792,000	
令和2年 2回 大阪市公募	300,000,000	294,120,000	

公債			
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	220,450,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	453,132,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	195,554,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	107,939,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	104,316,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	107,625,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	224,188,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	220,130,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	299,433,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	168,030,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	392,044,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	118,618,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	109,476,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	108,047,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	115,856,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	286,941,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	198,916,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	221,664,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	116,036,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	109,203,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	334,803,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	107,943,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	118,637,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	192,208,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	89,235,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,608,000	



	債			
	29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	192,052,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	300,126,000	
	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	96,540,000	
	令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	298,677,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	196,526,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	195,158,000	
	26年度1回 相模原市公募公債	100,000,000	100,613,000	
	26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	100,599,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	198,034,000	
地方債証券 合計		31,239,330,000	31,532,452,704	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	208,518,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	206,936,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,462,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	447,370,000	
	127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,860,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	83,854,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	388,840,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,715,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	391,551,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	190,155,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	243,728,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	386,067,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	274,803,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,919,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,965,000	
	139回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,555,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,053,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,620,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,374,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	97,771,000	

172回 高速道路機構債	200,000,000	185,470,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	95,618,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,088,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,567,000	
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	548,700,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,503,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,546,000	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,647,000	
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	503,565,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,858,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,844,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,510,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	518,895,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,051,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,673,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	187,348,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,068,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	800,976,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	193,866,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	95,840,000	
398回 政保道路債	300,000,000	239,235,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	155,818,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	165,590,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	167,762,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	602,430,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	218,426,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	332,886,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	333,588,000	

13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	111,828,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,479,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,404,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	109,214,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	219,034,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,252,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	338,190,000	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	108,263,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,950,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	533,820,000	
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	306,147,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,637,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	210,536,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,727,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,832,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,995,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	96,927,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,555,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,159,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,999,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,810,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	263,049,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	240,444,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	499,020,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	219,870,000	
40回 政保日本政策金融公	103,000,000	102,902,150	

庫債券			
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	104,832,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	104,164,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	206,162,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	168,048,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	106,555,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	100,706,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	221,014,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,199,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	390,386,500	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,582,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,283,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,221,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	281,337,500	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,128,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,933,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,930,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,589,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,856,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,570,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,775,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,775,000	
40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,164,000	42,599,554	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,295,000	15,971,497	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,160,000	102,442,589	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,528,000	153,177,440	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,547,000	21,414,494	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,691,000	18,405,716	

5 2 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	20,726,000	21,493,691	
5 3 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	21,731,000	22,535,047	
6 0 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	26,647,000	27,585,507	
6 4 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	65,344,000	67,240,282	
7 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	29,731,000	30,661,877	
8 2 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	35,785,000	36,554,377	
8 4 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	36,474,000	37,270,956	
8 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	40,101,000	40,927,481	
9 0 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	41,650,000	42,226,019	
9 3 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	46,967,000	46,835,962	
9 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	53,188,000	53,418,835	
9 9 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	55,099,000	55,701,783	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	207,819,000	203,176,323	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	70,466,000	69,306,129	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	70,029,000	68,953,354	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	70,287,000	69,144,133	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	219,684,000	215,068,439	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	219,759,000	215,014,403	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	149,706,000	146,370,550	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	224,211,000	218,897,199	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	222,747,000	217,510,218	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	387,415,000	379,581,468	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	77,326,000	75,694,421	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	79,783,000	77,241,911	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	256,086,000	246,523,748	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金	341,368,000	329,628,354	

融支援機構債券			
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	263,007,000	254,214,675	
168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	269,943,000	261,115,863	
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	820,935,000	792,251,531	
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	415,008,000	
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,021,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	99,885,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	298,917,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	298,638,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	199,036,000	
369回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	399,456,000	
377回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	299,163,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	109,536,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,102,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,765,000	
85回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,526,000	
87回 中日本高速道路債券	400,000,000	398,876,000	
71回 鉄道建設運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,649,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,272,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,414,000	
特殊債券 合計	29,516,399,000	29,985,992,976	
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	295,950,000	
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,638,000	
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	98,991,000	
25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,970,000	
27回 首都高速道路社債	400,000,000	399,024,000	
16回 成田国際空港社債	100,000,000	100,622,000	
37回 成田国際空港社債	100,000,000	88,805,000	
57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,809,000	
67回 東日本高速道路社債	200,000,000	196,748,000	
79回 東日本高速道路社債	300,000,000	298,902,000	
83回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,268,000	
90回 中日本高速道路債券	200,000,000	199,212,000	
91回 中日本高速道路債券	500,000,000	497,625,000	
25回 西日本高速道路社債	200,000,000	201,238,000	
26回 西日本高速道路社債	100,000,000	100,899,000	

33回	西日本高速道路債券	300,000,000	300,753,000	
34回	西日本高速道路債券	200,000,000	200,926,000	
61回	西日本高速道路債券	500,000,000	498,025,000	
62回	西日本高速道路債券	500,000,000	497,620,000	
24回	大和ハウス工業社債	200,000,000	199,048,000	
10回	麒麟ホールディングス社債	100,000,000	100,730,000	
3回	ダイドーグループHD社債	300,000,000	294,297,000	
9回	野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	96,571,000	
12回	セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,126,000	
14回	セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,746,000	
30回	東レ社債	300,000,000	299,703,000	
42回	王子ホールディングス社債	200,000,000	199,080,000	
23回	三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	188,378,000	
40回	三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,324,000	
17回	ダイセル社債	300,000,000	292,959,000	
16回	武田薬品工業社債	500,000,000	481,525,000	
4回	住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,802,000	
4回	ENEOSホールディングス社債	300,000,000	295,320,000	
14回	ブリヂストン社債	300,000,000	296,931,000	
35回	三菱マテリアル社債	300,000,000	298,311,000	
17回	パナソニック社債	100,000,000	100,316,000	
19回	パナソニック社債	100,000,000	96,726,000	
23回	パナソニック社債	200,000,000	191,730,000	
29回	三菱重工業社債	100,000,000	100,580,000	
58回	川崎重工業社債	300,000,000	287,949,000	
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	99,161,000	
26回	トヨタ自動車社債	200,000,000	199,198,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	94,802,000	
73回	三井物産社債	400,000,000	392,828,000	
12回	新生銀行社債	400,000,000	398,944,000	
88回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	107,479,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	105,514,000	
20回	三井住友信託銀行社債	300,000,000	298,146,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	200,926,000	
11回	セブン銀行社債	200,000,000	201,020,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	298,176,000	

17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	298,779,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	392,680,000	
69回 ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,422,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,754,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,560,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	194,926,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	291,249,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	98,625,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,130,000	
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,736,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	195,736,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	299,625,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	296,301,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	102,555,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	100,297,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	200,350,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	103,490,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	91,589,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	310,773,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	208,248,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	109,808,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,682,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	220,320,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	97,701,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	90,729,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	93,562,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,531,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	76,547,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,191,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	176,522,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	160,128,000	



債			
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,605,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	194,814,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	81,408,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	76,843,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,216,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	175,980,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,105,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	127,420,800	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	75,282,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	292,065,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	194,834,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	391,040,000	
30回 光通信社債	200,000,000	186,734,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	93,103,000	
532回 中部電力社債	200,000,000	194,886,000	
497回 関西電力社債	100,000,000	101,357,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	300,300,000	
530回 関西電力社債	400,000,000	393,500,000	
531回 関西電力社債	200,000,000	176,906,000	
541回 関西電力社債	300,000,000	286,902,000	
396回 中国電力社債	200,000,000	194,056,000	
425回 中国電力社債	100,000,000	97,299,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	102,167,000	
311回 北陸電力社債	100,000,000	101,828,000	
488回 東北電力社債	100,000,000	99,729,000	
521回 東北電力社債	400,000,000	391,404,000	
525回 東北電力社債	200,000,000	198,082,000	
536回 東北電力社債	300,000,000	285,483,000	
320回 四国電力社債	300,000,000	290,238,000	
463回 九州電力社債	100,000,000	92,007,000	
466回 九州電力社債	100,000,000	90,825,000	
491回 九州電力社債	300,000,000	288,411,000	
492回 九州電力社債	100,000,000	86,325,000	
493回 九州電力社債	200,000,000	198,494,000	
507回 九州電力社債	200,000,000	194,920,000	
321回 北海道電力社債	261,000,000	263,659,590	
340回 北海道電力社債	300,000,000	300,690,000	
350回 北海道電力社債	200,000,000	182,706,000	
13回 電源開発社債	200,000,000	206,924,000	
54回 電源開発社債	100,000,000	99,645,000	
75回 電源開発社債	200,000,000	191,162,000	
41回 東京瓦斯社債	200,000,000	186,446,000	
52回 東京瓦斯社債	100,000,000	89,010,000	
55回 東京瓦斯社債	100,000,000	85,578,000	
57回 東京瓦斯社債	300,000,000	214,131,000	
7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,536,000	
8回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	189,740,000	

社債券 合計	26,081,000,000	25,480,713,390	
合計		568,078,850,420	

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7月11日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,578,520円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,320,196,114円
O n eグローバルバランス	22,034,929円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	998,260,265円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,502,278,818円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,899,282,822円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	314,801,257円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,032,386,759円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,106,134,254円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,264,986円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	303,367,667円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	340,413,028円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	559,938,611円
投資のソムリエ	4,965,577,838円
クルーズコントロール	536,916,590円
投資のソムリエ<DC年金>	404,957,646円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	346,957,395円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	942,518,924円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	341,595,789円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,302,203,635円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	67,712,673円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	33,590,538円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,464,186円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	109,864,123円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	487,735,046円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	894,501,920円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	249,168,511円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	73,448,347円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	37,099,480円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	22,864,207円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	416,483,587円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,278,337円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,798,536円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	42,386,412円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	52,937,095円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	54,264,978円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	38,201,798円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	32,987,283円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	52,024,685円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	132,692,574円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	211,035,102円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	47,065,644円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	216,070,113円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	528,847,953円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	135,825,853円
AMOn eマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	27,267,111円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	26,546,249円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	143,932,219円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	88,094,308円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,929,774円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	40,211,940円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	82,383,139円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,836,743円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	12,710,824円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,753,268円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	85,624円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,640,628円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	19,601,758円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	352,786,196円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	463,833,725円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,379,791,757円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	12,295,790円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	18,194,450円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	183,671,454円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	34,317,799円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	59,127円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	230,233,903円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,634,330円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	45,414,027円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	105,243,918円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	151,146,760円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	19,934,144円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	13,359,047円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1306）（適格機関投資家限定）	4,159,759円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1309）（適格機関投資家限定）	36,747,909円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,408,586円
コア資産形成ファンド	15,941,080円
MHAMトピックスファンド	777,114,462円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	45,372,729円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,128,230,002円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,453,012,308円

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年7月11日現在 当期の

	損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	46,910,015,089
合計	46,910,015,089

(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7月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

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

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	6,900	3,610.00	24,909,000	
ニッスイ	183,600	665.00	122,094,000	
マルハニチロ	27,300	2,463.00	67,239,900	
雪国まいたけ	15,600	930.00	14,508,000	
カネコ種苗	5,700	1,398.00	7,968,600	
サカタのタネ	20,800	4,080.00	84,864,000	
ホクト	16,400	1,827.00	29,962,800	
ホクリヨウ	2,100	875.00	1,837,500	
ショーボンドホールディングス	25,000	5,604.00	140,100,000	
ミライト・ワン	60,800	1,799.00	109,379,200	
タマホーム	11,500	3,275.00	37,662,500	
サンヨーホームズ	1,800	729.00	1,312,200	



日本アクア	5,900	872.00	5,144,800
ファーストコーポレーション	3,700	810.00	2,997,000
ベステラ	3,200	1,103.00	3,529,600
Robot Home	31,300	192.00	6,009,600
キャンディル	2,700	590.00	1,593,000
住石ホールディングス	22,200	359.00	7,969,800
日鉄鉱業	7,300	4,565.00	33,324,500
三井松島ホールディングス	8,300	2,634.00	21,862,200
INPEX	678,900	1,626.00	1,103,891,400
石油資源開発	21,200	4,415.00	93,598,000
K&Oエナジーグループ	8,300	2,195.00	18,218,500
ダイセキ環境ソリューション	3,000	1,420.00	4,260,000
第一カッター興業	4,800	1,401.00	6,724,800
明豊ファシリティワークス	5,300	751.00	3,980,300
安藤・間	106,300	1,066.00	113,315,800
東急建設	52,200	735.00	38,367,000
コムシスホールディングス	58,600	2,754.50	161,413,700
ビーアールホールディングス	29,200	386.00	11,271,200
高松コンストラクショングループ	12,000	2,521.00	30,252,000
東建コーポレーション	5,300	7,330.00	38,849,000
ソネック	1,600	967.00	1,547,200
ヤマウラ	9,300	1,140.00	10,602,000
オリエンタル白石	65,800	299.00	19,674,200
大成建設	120,100	5,107.00	613,350,700
大林組	459,100	1,230.00	564,693,000
清水建設	364,100	894.50	325,687,450
飛島建設	14,200	1,280.00	18,176,000
長谷工コーポレーション	132,500	1,792.50	237,506,250
松井建設	12,000	707.00	8,484,000
銭高組	1,300	3,110.00	4,043,000
鹿島建設	284,500	2,122.50	603,851,250
不動テトラ	8,800	1,840.00	16,192,000
大末建設	3,700	1,340.00	4,958,000
鉄建建設	9,100	2,023.00	18,409,300
西松建設	21,800	3,543.00	77,237,400
三井住友建設	103,500	372.00	38,502,000
大豊建設	5,400	3,800.00	20,520,000
佐田建設	6,300	461.00	2,904,300
ナカノフドー建設	7,000	388.00	2,716,000
奥村組	20,800	4,045.00	84,136,000
東鉄工業	17,700	2,613.00	46,250,100
イチケン	2,300	1,957.00	4,501,100
富士ピー・エス	4,700	445.00	2,091,500
浅沼組	10,300	3,310.00	34,093,000
戸田建設	158,000	767.60	121,280,800
熊谷組	21,500	3,100.00	66,650,000
北野建設	1,900	2,988.00	5,677,200
植木組	3,000	1,386.00	4,158,000
矢作建設工業	17,500	1,231.00	21,542,500
ピーエス三菱	16,300	776.00	12,648,800

日本ハウスホールディングス	25,400	370.00	9,398,000
大東建託	47,300	14,170.00	670,241,000
新日本建設	18,000	1,223.00	22,014,000
東亜道路工業	5,200	4,500.00	23,400,000
日本道路	2,700	8,750.00	23,625,000
東亜建設工業	11,000	3,090.00	33,990,000
日本国土開発	38,500	576.00	22,176,000
若築建設	5,800	2,958.00	17,156,400
東洋建設	41,600	1,038.00	43,180,800
五洋建設	182,000	750.20	136,536,400
世紀東急工業	16,600	1,415.00	23,489,000
福田組	4,900	4,780.00	23,422,000
日本ドライケミカル	2,500	1,733.00	4,332,500
住友林業	98,500	3,288.00	323,868,000
日本基礎技術	6,000	505.00	3,030,000
巴コーポレーション	11,200	497.00	5,566,400
大和ハウス工業	355,100	3,667.00	1,302,151,700
ライト工業	23,800	1,979.00	47,100,200
積水ハウス	389,300	2,843.50	1,106,974,550
日特建設	12,300	1,071.00	13,173,300
北陸電気工事	8,800	925.00	8,140,000
ユアテック	28,400	864.00	24,537,600
日本リーテック	11,300	1,374.00	15,526,200
四電工	5,500	2,217.00	12,193,500
中電工	20,000	2,307.00	46,140,000
関電工	70,500	1,185.00	83,542,500
きんでん	90,400	1,957.00	176,912,800
東京エネシス	12,900	960.00	12,384,000
トーエネック	4,300	3,595.00	15,458,500
住友電設	12,300	3,135.00	38,560,500
日本電設工業	21,100	2,030.00	42,833,000
エクシオグループ	59,200	2,822.00	167,062,400
新日本空調	7,000	2,333.00	16,331,000
九電工	31,300	3,979.00	124,542,700
三機工業	28,600	1,510.00	43,186,000
日揮ホールディングス	127,100	1,804.50	229,351,950
中外炉工業	4,300	1,987.00	8,544,100
ヤマト	8,300	867.00	7,196,100
太平電業	7,900	4,230.00	33,417,000
高砂熱学工業	31,000	2,438.00	75,578,000
三晃金属工業	1,200	4,390.00	5,268,000
NEC ネットズエスアイ	43,900	1,944.00	85,341,600
朝日工業社	5,400	2,397.00	12,943,800
明星工業	22,100	953.00	21,061,300
大気社	14,800	3,970.00	58,756,000
ダイダン	8,300	2,814.00	23,356,200
日比谷総合設備	11,000	2,149.00	23,639,000
ニッポン	34,600	1,820.00	62,972,000
日清製粉グループ本社	119,300	1,702.00	203,048,600
日東富士製粉	2,200	4,605.00	10,131,000

昭和産業	11,200	2,638.00	29,545,600
鳥越製粉	7,900	615.00	4,858,500
中部飼料	17,800	1,070.00	19,046,000
フィード・ワン	18,800	750.00	14,100,000
東洋精糖	1,900	1,657.00	3,148,300
日本甜菜製糖	7,400	1,867.00	13,815,800
DM三井製糖ホールディングス	12,900	2,701.00	34,842,900
塩水港精糖	12,100	213.00	2,577,300
ウェルネオシュガー	6,600	2,025.00	13,365,000
L I F U L L	46,000	302.00	13,892,000
M I X I	30,600	2,639.00	80,753,400
ジェイエイシーリクルートメント	12,200	2,613.00	31,878,600
日本M&Aセンターホールディングス	230,900	1,068.50	246,716,650
メンバーズ	4,000	1,646.00	6,584,000
中広	1,000	406.00	406,000
UTグループ	19,800	2,765.00	54,747,000
アイティメディア	5,200	1,326.00	6,895,200
E・Jホールディングス	7,800	1,569.00	12,238,200
オープンアップグループ	40,400	2,012.00	81,284,800
コシダカホールディングス	40,400	1,187.00	47,954,800
アルトナー	2,600	1,883.00	4,895,800
パソナグループ	16,400	1,682.00	27,584,800
CDS	2,700	1,751.00	4,727,700
リンクアンドモチベーション	38,800	424.00	16,451,200
エス・エム・エス	51,200	2,787.00	142,694,400
サニーサイドアップグループ	3,200	729.00	2,332,800
パーソルホールディングス	148,400	2,593.50	384,875,400
リニカル	5,900	785.00	4,631,500
クックパッド	36,800	164.00	6,035,200
エスクリ	4,300	410.00	1,763,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,200	592.00	3,078,400
森永製菓	23,600	4,509.00	106,412,400
中村屋	3,300	3,080.00	10,164,000
江崎グリコ	36,900	3,664.00	135,201,600
名糖産業	5,100	1,629.00	8,307,900
井村屋グループ	6,900	2,227.00	15,366,300
不二家	8,700	2,416.00	21,019,200
山崎製パン	86,400	2,010.00	173,664,000
第一屋製パン	2,000	389.00	778,000
モロゾフ	4,200	3,750.00	15,750,000
亀田製菓	8,200	4,325.00	35,465,000
寿スピリッツ	13,800	10,160.00	140,208,000
カルビー	59,000	2,726.50	160,863,500
森永乳業	23,400	4,656.00	108,950,400
六甲バター	9,400	1,300.00	12,220,000
ヤクルト本社	92,000	8,878.00	816,776,000
明治ホールディングス	158,100	3,260.00	515,406,000
雪印メグミルク	31,200	1,899.00	59,248,800
プリマハム	17,400	2,174.00	37,827,600
日本ハム	50,400	3,925.00	197,820,000

林兼産業	3,200	494.00	1,580,800
丸大食品	13,100	1,478.00	19,361,800
S Foods	14,300	3,135.00	44,830,500
柿安本店	5,100	2,337.00	11,918,700
伊藤ハム米久ホールディングス	98,500	712.00	70,132,000
学情	6,000	1,905.00	11,430,000
スタジオアリス	6,700	2,164.00	14,498,800
クロスキャット	7,400	1,146.00	8,480,400
シミックホールディングス	6,400	1,894.00	12,121,600
エプロ	2,300	733.00	1,685,900
システナ	220,700	285.00	62,899,500
NJS	2,600	2,653.00	6,897,800
デジタルアーツ	8,300	5,660.00	46,978,000
日鉄ソリューションズ	22,400	3,925.00	87,920,000
総合警備保障	250,000	791.30	197,825,000
キューブシステム	7,700	1,206.00	9,286,200
いちご	148,400	286.00	42,442,400
日本駐車場開発	136,500	222.00	30,303,000
コア	5,800	1,740.00	10,092,000
カカクコム	98,700	2,035.00	200,854,500
アイロムグループ	4,900	1,923.00	9,422,700
セントケア・ホールディング	8,500	771.00	6,553,500
サイネックス	1,800	651.00	1,171,800
ルネサンス	9,400	905.00	8,507,000
ディップ	23,600	3,540.00	83,544,000
SBSホールディングス	11,700	3,230.00	37,791,000
デジタルホールディングス	10,500	1,063.00	11,161,500
新日本科学	14,300	2,057.00	29,415,100
キャリアデザインセンター	2,200	1,636.00	3,599,200
ベネフィット・ワン	62,300	1,393.50	86,815,050
エムスリー	265,900	3,058.00	813,122,200
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	457.00	3,061,900
プラス	1,200	970.00	1,164,000
アウトソーシング	80,100	1,349.00	108,054,900
ウェルネット	7,900	576.00	4,550,400
ワールドホールディングス	6,000	2,602.00	15,612,000
ディー・エヌ・エー	53,700	1,804.50	96,901,650
博報堂DYホールディングス	171,700	1,478.50	253,858,450
ぐるなび	24,700	379.00	9,361,300
タカミヤ	18,300	536.00	9,808,800
ジャパンベストレスキューシステム	6,700	734.00	4,917,800
ファンコミュニケーションズ	26,500	400.00	10,600,000
ライク	5,100	1,683.00	8,583,300
ビジネス・ブレークスルー	4,000	440.00	1,760,000
エスプール	38,700	618.00	23,916,600
WDBホールディングス	6,900	2,040.00	14,076,000
手間いらず	2,300	3,820.00	8,786,000
ティア	6,100	450.00	2,745,000
CDG	1,200	1,352.00	1,622,400
アドウェイズ	18,500	658.00	12,173,000

バリューコマース	10,100	1,322.00	13,352,200
インフォマート	139,700	334.00	46,659,800
サッポロホールディングス	42,400	3,611.00	153,106,400
アサヒグループホールディングス	297,900	5,394.00	1,606,872,600
キリンホールディングス	581,700	2,060.50	1,198,592,850
宝ホールディングス	88,000	1,138.00	100,144,000
オエノンホールディングス	38,600	343.00	13,239,800
養命酒製造	4,300	1,850.00	7,955,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	101,000	1,543.50	155,893,500
サントリー食品インターナショナル	90,700	5,000.00	453,500,000
ダイドーグループホールディングス	7,200	5,000.00	36,000,000
伊藤園	43,700	3,945.00	172,396,500
キーコーヒー	14,400	2,053.00	29,563,200
ユニカフェ	3,500	913.00	3,195,500
ジャパンフーズ	1,600	1,073.00	1,716,800
日清オイリオグループ	18,100	3,635.00	65,793,500
不二製油グループ本社	30,000	1,978.50	59,355,000
かどや製油	1,200	3,430.00	4,116,000
J-オイルミルズ	13,100	1,609.00	21,077,900
ローソン	34,400	6,261.00	215,378,400
サンエー	10,600	4,715.00	49,979,000
カワチ薬品	10,800	2,184.00	23,587,200
エービーシー・マート	20,200	7,703.00	155,600,600
ハードオフコーポレーション	4,400	1,525.00	6,710,000
高千穂交易	3,900	3,095.00	12,070,500
アスクル	28,700	2,084.00	59,810,800
ゲオホールディングス	13,600	1,942.00	26,411,200
アダストリア	16,800	2,836.00	47,644,800
ジーフット	6,500	277.00	1,800,500
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,400	577.00	807,800
オルバヘルスケアホールディングス	1,600	1,727.00	2,763,200
伊藤忠食品	3,200	5,120.00	16,384,000
くら寿司	16,200	3,100.00	50,220,000
キャンドゥ	5,000	2,514.00	12,570,000
エレマテック	12,500	1,808.00	22,600,000
I Kホールディングス	3,500	377.00	1,319,500
パルグループホールディングス	13,600	3,855.00	52,428,000
エディオン	54,800	1,460.00	80,008,000
あらた	10,600	4,845.00	51,357,000
サーラコーポレーション	29,100	728.00	21,184,800
ワッツ	5,300	642.00	3,402,600
トーマンデバイス	2,000	4,890.00	9,780,000
ハローズ	6,200	3,760.00	23,312,000
J Pホールディングス	38,700	322.00	12,461,400
フジオフードグループ本社	15,400	1,416.00	21,806,400
あみやき亭	3,500	3,315.00	11,602,500
東京エレクトロン デバイス	5,200	10,140.00	52,728,000
ひらまつ	23,100	251.00	5,798,100
円谷フィールズホールディングス	23,800	2,831.00	67,377,800

双日	138,100	3,233.00	446,477,300
アルフレッサ ホールディングス	139,000	2,124.00	295,236,000
大黒天物産	4,300	5,780.00	24,854,000
ハニーズホールディングス	10,900	1,787.00	19,478,300
ファーマライズホールディングス	2,500	615.00	1,537,500
キッコーマン	85,500	7,856.00	671,688,000
味の素	311,200	5,460.00	1,699,152,000
ブルドックソース	6,800	1,906.00	12,960,800
キューピー	69,300	2,423.50	167,948,550
ハウス食品グループ本社	39,500	3,258.00	128,691,000
カゴメ	60,200	3,130.00	188,426,000
焼津水産化学工業	4,000	819.00	3,276,000
アリアケジャパン	11,200	5,235.00	58,632,000
ピエトロ	1,500	1,819.00	2,728,500
エバラ食品工業	3,600	2,867.00	10,321,200
やまみ	1,000	1,317.00	1,317,000
ニチレイ	59,100	3,034.00	179,309,400
横浜冷凍	37,700	1,174.00	44,259,800
東洋水産	65,100	6,043.00	393,399,300
イートアンドホールディングス	5,500	2,138.00	11,759,000
大冷	1,200	1,956.00	2,347,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	864.00	6,998,400
日清食品ホールディングス	45,300	11,845.00	536,578,500
永谷園ホールディングス	6,300	2,132.00	13,431,600
一正蒲鉾	4,400	726.00	3,194,400
フジッコ	13,200	1,879.00	24,802,800
ロック・フィールド	14,400	1,475.00	21,240,000
日本たばこ産業	848,600	3,038.00	2,578,046,800
ケンコーマヨネーズ	8,800	1,312.00	11,545,600
わらべや日洋ホールディングス	9,400	2,573.00	24,186,200
なとり	8,100	1,947.00	15,770,700
イフジ産業	1,800	1,098.00	1,976,400
ファーマフーズ	18,500	1,827.00	33,799,500
北の達人コーポレーション	55,200	281.00	15,511,200
ユーグレナ	83,300	895.00	74,553,500
紀文食品	10,000	1,026.00	10,260,000
ピクルスホールディングス	7,500	1,294.00	9,705,000
スター・マイカ・ホールディングス	11,600	615.00	7,134,000
SREホールディングス	6,300	3,620.00	22,806,000
ADワークスグループ	25,100	199.00	4,994,900
片倉工業	12,100	1,615.00	19,541,500
グンゼ	9,300	4,340.00	40,362,000
ヒューリック	300,700	1,199.00	360,539,300
神栄	1,400	1,049.00	1,468,600
ラサ商事	5,000	1,444.00	7,220,000
アルペン	11,400	1,974.00	22,503,600
ハブ	3,600	843.00	3,034,800
ラクーンホールディングス	10,800	678.00	7,322,400
クオールホールディングス	19,100	1,715.00	32,756,500
アルコニックス	18,200	1,374.00	25,006,800

神戸物産	107,200	3,628.00	388,921,600
ソリトンシステムズ	6,700	1,230.00	8,241,000
ジンズホールディングス	8,200	3,370.00	27,634,000
ビックカメラ	73,700	1,091.00	80,406,700
DCMホールディングス	80,500	1,207.00	97,163,500
ペッパーフードサービス	31,800	132.00	4,197,600
ハイパー	2,100	447.00	938,700
MonotaRO	196,300	1,751.50	343,819,450
東京一番フーズ	2,600	505.00	1,313,000
DDグループ	6,900	1,292.00	8,914,800
あいホールディングス	22,200	2,220.00	49,284,000
ディーブイエックス	3,100	875.00	2,712,500
きちりホールディングス	2,600	832.00	2,163,200
アークランドサービスホールディングス	11,300	2,909.00	32,871,700
J. フロント リテイリング	172,300	1,359.00	234,155,700
ドトール・日レスホールディングス	24,500	2,071.00	50,739,500
マツキヨココカラ&カンパニー	84,000	7,997.00	671,748,000
ブロンコビリー	7,300	2,755.00	20,111,500
ZOZO	91,500	2,832.50	259,173,750
トレジャー・ファクトリー	6,600	1,828.00	12,064,800
物語コーポレーション	23,100	3,300.00	76,230,000
三越伊勢丹ホールディングス	233,200	1,451.00	338,373,200
東洋紡	56,600	1,083.00	61,297,800
ユニチカ	39,500	236.00	9,322,000
富士紡ホールディングス	5,200	3,170.00	16,484,000
日清紡ホールディングス	107,700	1,199.00	129,132,300
倉敷紡績	9,800	2,262.00	22,167,600
ダイワボウホールディングス	56,600	2,702.00	152,933,200
シキボウ	5,700	1,020.00	5,814,000
日東紡績	14,800	2,310.00	34,188,000
トヨタ紡織	55,100	2,490.00	137,199,000
マクニカホールディングス	32,800	5,800.00	190,240,000
Hamee	4,800	963.00	4,622,400
マーケットエンタープライズ	1,200	1,584.00	1,900,800
ラクト・ジャパン	5,400	2,045.00	11,043,000
ウエルシアホールディングス	71,900	2,772.00	199,306,800
クリエイトSDホールディングス	22,900	3,470.00	79,463,000
グリムス	5,800	2,946.00	17,086,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,200	918.00	18,543,600
八洲電機	11,200	1,345.00	15,064,000
メディアスホールディングス	8,800	788.00	6,934,400
レスターホールディングス	13,300	2,317.00	30,816,100
ジュエテックホールディングス	2,600	1,170.00	3,042,000
丸善CHIホールディングス	12,800	354.00	4,531,200
大光	4,600	595.00	2,737,000
OCHIホールディングス	2,500	1,310.00	3,275,000
TOKAIホールディングス	68,400	894.00	61,149,600
黒谷	3,200	596.00	1,907,200

ミサワ	2,000	613.00	1,226,000
ティーライフ	1,500	1,545.00	2,317,500
C o m i n i x	2,200	854.00	1,878,800
エー・ピーホールディングス	2,300	846.00	1,945,800
三洋貿易	15,600	1,347.00	21,013,200
チムニー	3,500	1,307.00	4,574,500
シュッピン	10,300	1,084.00	11,165,200
ビューティガレージ	2,200	4,590.00	10,098,000
オイシックス・ラ・大地	18,600	2,381.00	44,286,600
ウイン・パートナーズ	10,100	1,056.00	10,665,600
ネクステージ	31,700	3,685.00	116,814,500
ジョイフル本田	40,300	1,641.00	66,132,300
鳥貴族ホールディングス	5,200	2,612.00	13,582,400
ホットランド	10,600	1,638.00	17,362,800
すかいらーくホールディングス	189,300	1,753.50	331,937,550
S F Pホールディングス	7,500	2,198.00	16,485,000
綿半ホールディングス	10,700	1,350.00	14,445,000
日本毛織	34,600	1,025.00	35,465,000
ダイトウボウ	16,500	93.00	1,534,500
トーア紡コーポレーション	4,100	444.00	1,820,400
ダイドーリミテッド	14,700	298.00	4,380,600
ヨシックスホールディングス	2,200	2,496.00	5,491,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,100	1,128.00	50,872,800
三栄建築設計	6,200	1,449.00	8,983,800
野村不動産ホールディングス	80,600	3,464.00	279,198,400
三重交通グループホールディングス	27,600	554.00	15,290,400
サムティ	20,500	2,244.00	46,002,000
ディア・ライフ	22,000	831.00	18,282,000
コーセーアールイー	3,300	788.00	2,600,400
地主	9,800	1,874.00	18,365,200
プレサンスコーポレーション	20,300	1,998.00	40,559,400
フィル・カンパニー	2,300	944.00	2,171,200
T H E グローバル社	5,800	289.00	1,676,200
ハウスコム	1,600	925.00	1,480,000
J P M C	6,500	1,088.00	7,072,000
サンセイランディック	3,000	983.00	2,949,000
エストラスト	1,300	636.00	826,800
フージャースホールディングス	19,900	989.00	19,681,100
オープンハウスグループ	47,300	5,064.00	239,527,200
東急不動産ホールディングス	387,500	816.60	316,432,500
飯田グループホールディングス	112,900	2,431.00	274,459,900
イーグランド	1,500	1,529.00	2,293,500
ムゲンエステート	6,700	700.00	4,690,000
帝国繊維	14,800	1,661.00	24,582,800
日本コークス工業	118,600	117.00	13,876,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	790.00	4,898,000
ミタチ産業	2,800	1,115.00	3,122,000
B E E N O S	5,900	1,986.00	11,717,400
あさひ	11,500	1,255.00	14,432,500



日本調剤	9,400	1,201.00	11,289,400
コスモス薬品	13,700	16,020.00	219,474,000
シップヘルスケアホールディングス	49,800	2,295.00	114,291,000
トーエル	4,800	736.00	3,532,800
ソフトクリエイトホールディングス	10,700	1,736.00	18,575,200
セブン&アイ・ホールディングス	477,400	6,000.00	2,864,400,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	104,100	974.00	101,393,400
明治電機工業	5,200	1,473.00	7,659,600
ツルハホールディングス	29,100	10,795.00	314,134,500
デリカフーズホールディングス	4,300	590.00	2,537,000
スターティアホールディングス	2,100	1,310.00	2,751,000
サンマルクホールディングス	11,100	1,866.00	20,712,600
フェリシモ	2,500	1,014.00	2,535,000
トリドールホールディングス	34,500	3,190.00	110,055,000
帝人	126,000	1,457.00	183,582,000
東レ	878,600	788.30	692,600,380
クラレ	208,500	1,363.00	284,185,500
旭化成	818,900	968.00	792,695,200
TOKYO BASE	14,300	347.00	4,962,100
稲葉製作所	6,900	1,610.00	11,109,000
宮地エンジニアリンググループ	3,800	4,060.00	15,428,000
トーカロ	36,000	1,446.00	52,056,000
アルファ	3,900	1,265.00	4,933,500
SUMCO	257,100	2,072.00	532,711,200
川田テクノロジーズ	3,300	5,700.00	18,810,000
RS Technologies	8,900	3,020.00	26,878,000
ジェイテックコーポレーション	1,400	2,229.00	3,120,600
信和	5,800	763.00	4,425,400
ビーロッド	6,800	706.00	4,800,800
ファーストブラザーズ	2,100	1,039.00	2,181,900
And Doホールディングス	7,600	1,085.00	8,246,000
シーアールイー	7,100	1,392.00	9,883,200
プロパティエージェント	1,200	1,192.00	1,430,400
ケイアイスター不動産	6,100	4,775.00	29,127,500
アグレ都市デザイン	1,800	1,609.00	2,896,200
グッドコムアセット	12,000	814.00	9,768,000
ジェイ・エス・ビー	3,300	4,925.00	16,252,500
ロードスターキャピタル	7,200	1,628.00	11,721,600
テンポイノベーション	3,100	1,155.00	3,580,500
グローバル・リンク・マネジメント	1,900	1,475.00	2,802,500
フェイスネットワーク	2,800	1,483.00	4,152,400
住江織物	2,100	2,495.00	5,239,500
日本フェルト	5,800	416.00	2,412,800
イチカワ	1,300	1,355.00	1,761,500
エコナックホールディングス	18,000	95.00	1,710,000
日東製網	1,100	1,382.00	1,520,200
芦森工業	1,900	1,873.00	3,558,700
アツギ	5,900	419.00	2,472,100
ウイルプラスホールディングス	1,700	1,175.00	1,997,500

J Mホールディングス	10,500	1,986.00	20,853,000
コメダホールディングス	33,900	2,698.00	91,462,200
サツドラホールディングス	4,900	764.00	3,743,600
アレンザホールディングス	10,400	988.00	10,275,200
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,674.00	6,193,800
バロックジャパンリミテッド	8,900	903.00	8,036,700
クスリのアオキホールディングス	12,400	7,926.00	98,282,400
ダイニック	2,700	752.00	2,030,400
共和レザー	5,900	601.00	3,545,900
ピーバンドットコム	1,500	464.00	696,000
力の源ホールディングス	6,100	2,043.00	12,462,300
FOOD & LIFE COMPANIES	73,900	2,670.00	197,313,000
アセンテック	4,800	706.00	3,388,800
セーレン	25,200	2,409.00	60,706,800
ソトー	3,400	773.00	2,628,200
東海染工	1,100	1,105.00	1,215,500
小松マテーレ	19,000	686.00	13,034,000
ワコールホールディングス	23,900	2,918.00	69,740,200
ホギメディカル	17,600	3,075.00	54,120,000
クラウドディアホールディングス	2,400	781.00	1,874,400
T S Iホールディングス	44,100	829.00	36,558,900
マツオカコーポレーション	2,900	1,264.00	3,665,600
ワールド	16,900	1,738.00	29,372,200
T I S	143,700	3,573.00	513,440,100
J N Sホールディングス	4,800	561.00	2,692,800
グリー	35,100	615.00	21,586,500
GMOペパボ	1,900	1,721.00	3,269,900
コーエーテクモホールディングス	82,200	2,339.50	192,306,900
三菱総合研究所	6,400	5,350.00	34,240,000
ボルテージ	3,000	314.00	942,000
電算	900	1,586.00	1,427,400
A G S	4,400	729.00	3,207,600
ファインデックス	10,400	610.00	6,344,000
ブレインパッド	9,800	937.00	9,182,600
K L a b	26,100	334.00	8,717,400
ポールトゥウィンホールディングス	22,500	738.00	16,605,000
ネクソン	334,400	2,651.00	886,494,400
アイスタイル	38,200	541.00	20,666,200
エムアップホールディングス	16,100	1,168.00	18,804,800
エイチーム	7,700	711.00	5,474,700
エニグモ	16,700	407.00	6,796,900
テクノスジャパン	8,300	660.00	5,478,000
e n i s h	7,600	337.00	2,561,200
コロプラ	51,000	640.00	32,640,000
オルトプラス	7,600	225.00	1,710,000
ブロードリーフ	76,600	438.00	33,550,800
クロス・マーケティンググループ	6,100	827.00	5,044,700
デジタルハーツホールディングス	8,200	1,284.00	10,528,800
システム情報	10,400	763.00	7,935,200

メディアドゥ	5,400	1,466.00	7,916,400
じげん	38,300	728.00	27,882,400
ブイキューブ	15,700	474.00	7,441,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	511.00	1,277,500
サイバーリンクス	3,400	734.00	2,495,600
ディー・エル・イー	7,200	252.00	1,814,400
フィックスターズ	14,800	1,414.00	20,927,200
CARTA HOLDINGS	6,100	1,214.00	7,405,400
オブティム	10,700	987.00	10,560,900
セレス	5,300	1,025.00	5,432,500
SHIFT	8,600	25,680.00	220,848,000
特種東海製紙	5,900	3,240.00	19,116,000
ティーガイア	13,800	1,723.00	23,777,400
セック	1,400	3,090.00	4,326,000
テクマトリックス	23,900	1,769.00	42,279,100
プロシップ	5,800	1,374.00	7,969,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,500	2,659.00	102,371,500
GMOペイメントゲートウェイ	26,200	10,780.00	282,436,000
ザッパラス	2,900	423.00	1,226,700
システムリサーチ	4,200	2,633.00	11,058,600
インターネットイニシアティブ	71,700	2,537.00	181,902,900
さくらインターネット	14,700	1,203.00	17,684,100
ヴィンクス	3,100	1,314.00	4,073,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,100	3,115.00	12,771,500
SRAホールディングス	6,700	3,135.00	21,004,500
システムインテグレータ	3,200	438.00	1,401,600
朝日ネット	14,200	647.00	9,187,400
eBASE	18,400	713.00	13,119,200
アバントグループ	16,600	1,402.00	23,273,200
アドソル日進	5,600	1,677.00	9,391,200
ODKソリューションズ	2,300	557.00	1,281,100
フリービット	6,900	1,310.00	9,039,000
コムチュア	17,400	1,962.00	34,138,800
サイバーコム	1,700	1,368.00	2,325,600
アステリア	10,300	873.00	8,991,900
アイル	6,100	2,688.00	16,396,800
王子ホールディングス	546,300	525.00	286,807,500
日本製紙	68,300	1,182.00	80,730,600
三菱製紙	12,300	572.00	7,035,600
北越コーポレーション	82,800	802.00	66,405,600
中越パルプ工業	4,200	1,343.00	5,640,600
巴川製紙所	3,300	710.00	2,343,000
大王製紙	58,000	1,100.00	63,800,000
阿波製紙	2,500	558.00	1,395,000
マークライNZ	7,000	2,482.00	17,374,000
メディカル・データ・ビジョン	19,600	716.00	14,033,600
gumi	19,300	695.00	13,413,500
ショーケース	2,400	390.00	936,000

モバイルファクトリー	2,200	839.00	1,845,800
テラスカイ	5,700	2,578.00	14,694,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	7,500	1,571.00	11,782,500
PCIホールディングス	3,900	1,142.00	4,453,800
アイビーシー	1,600	575.00	920,000
ネオジャパン	4,500	1,063.00	4,783,500
PR TIMES	3,400	1,430.00	4,862,000
ラクス	62,100	2,298.50	142,736,850
ランドコンピュータ	2,500	1,240.00	3,100,000
ダブルスタンダード	5,400	2,429.00	13,116,600
オープンドア	9,100	1,287.00	11,711,700
マイネット	3,400	337.00	1,145,800
アカツキ	6,200	2,057.00	12,753,400
ベネフィットジャパン	700	1,186.00	830,200
Ubicomホールディングス	4,100	1,458.00	5,977,800
カナミックネットワーク	14,200	453.00	6,432,600
ノムラシステムコーポレーション	9,600	125.00	1,200,000
レンゴー	119,400	861.50	102,863,100
トーモク	7,500	2,080.00	15,600,000
ザ・パック	9,700	3,055.00	29,633,500
チェンジホールディングス	32,100	2,136.00	68,565,600
シンクロ・フード	6,400	675.00	4,320,000
オークネット	6,400	1,712.00	10,956,800
キャピタル・アセット・プランニング	2,000	809.00	1,618,000
セグエグループ	2,900	1,073.00	3,111,700
エイトレッド	1,600	1,435.00	2,296,000
マクロミル	25,700	809.00	20,791,300
ビーグリー	1,700	1,119.00	1,902,300
オロ	4,000	1,916.00	7,664,000
ユーザーローカル	4,800	2,427.00	11,649,600
テモナ	2,300	293.00	673,900
ニーズウェル	5,700	773.00	4,406,100
マネーフォワード	31,700	5,675.00	179,897,500
サインポスト	4,000	549.00	2,196,000
レゾナック・ホールディングス	126,800	2,308.00	292,654,400
住友化学	972,800	435.50	423,654,400
住友精化	5,500	4,415.00	24,282,500
日産化学	62,000	6,182.00	383,284,000
ラサ工業	5,100	2,098.00	10,699,800
クレハ	11,200	8,230.00	92,176,000
多木化学	5,100	4,070.00	20,757,000
テイカ	8,800	1,365.00	12,012,000
石原産業	23,700	1,271.00	30,122,700
片倉コープアグリ	2,100	1,229.00	2,580,900
日本曹達	14,100	5,090.00	71,769,000
東ソー	175,000	1,730.50	302,837,500
トクヤマ	42,300	2,314.00	97,882,200
セントラル硝子	21,000	3,030.00	63,630,000
東亜合成	65,700	1,287.00	84,555,900

大阪ソーダ	7,800	5,430.00	42,354,000
関東電化工業	25,300	958.00	24,237,400
SUN ASTERISK	9,200	1,167.00	10,736,400
デンカ	47,800	2,707.50	129,418,500
イビデン	75,800	8,200.00	621,560,000
信越化学工業	1,090,000	4,584.00	4,996,560,000
日本カーバイド工業	3,900	1,418.00	5,530,200
電算システムホールディングス	6,300	3,185.00	20,065,500
堺化学工業	10,000	1,903.00	19,030,000
第一稀元素化学工業	12,000	970.00	11,640,000
エア・ウォーター	123,700	1,908.00	236,019,600
日本酸素ホールディングス	127,200	2,984.00	379,564,800
日本化学工業	4,500	1,905.00	8,572,500
東邦アセチレン	2,200	1,414.00	3,110,800
日本パーカライジング	64,900	1,066.00	69,183,400
高压ガス工業	19,100	743.00	14,191,300
チタン工業	1,200	1,388.00	1,665,600
四国化成ホールディングス	15,600	1,439.00	22,448,400
戸田工業	3,100	2,227.00	6,903,700
ステラ ケミファ	7,700	3,070.00	23,639,000
保土谷化学工業	3,800	3,395.00	12,901,000
日本触媒	20,000	5,293.00	105,860,000
大日精化工業	9,000	2,086.00	18,774,000
カネカ	29,900	3,989.00	119,271,100
協和キリン	158,600	2,590.00	410,774,000
APPIER GROUP	49,700	1,606.00	79,818,200
三菱瓦斯化学	98,000	2,135.50	209,279,000
三井化学	108,200	4,070.00	440,374,000
JSR	122,400	4,095.00	501,228,000
東京応化工業	22,900	8,556.00	195,932,400
大阪有機化学工業	9,800	2,766.00	27,106,800
三菱ケミカルグループ	884,900	838.00	741,546,200
KHネオケム	21,800	2,288.00	49,878,400
ダイセル	182,600	1,280.50	233,819,300
住友ベークライト	19,500	5,629.00	109,765,500
積水化学工業	265,800	2,011.50	534,656,700
日本ゼオン	78,600	1,347.00	105,874,200
アイカ工業	33,200	3,121.00	103,617,200
UBE	67,600	2,460.50	166,329,800
積水樹脂	18,200	2,251.00	40,968,200
タキロンシーアイ	28,800	574.00	16,531,200
旭有機材	8,600	4,280.00	36,808,000
ニチバン	8,100	1,884.00	15,260,400
リケンテクノス	28,300	645.00	18,253,500
大倉工業	6,000	2,190.00	13,140,000
積水化成成品工業	18,300	442.00	8,088,600
群栄化学工業	2,700	2,869.00	7,746,300
タイガースポリマー	4,800	699.00	3,355,200
ミライアル	3,200	1,602.00	5,126,400
ダイキアクシス	3,800	715.00	2,717,000

ダイキョーニシカワ	29,000	767.00	22,243,000
竹本容器	3,600	825.00	2,970,000
森六ホールディングス	6,600	2,067.00	13,642,200
恵和	8,400	1,104.00	9,273,600
日本化薬	100,200	1,196.00	119,839,200
カーリットホールディングス	11,800	801.00	9,451,800
ソルクシーズ	8,200	429.00	3,517,800
C Lホールディングス	3,800	814.00	3,093,200
プレステージ・インターナショナル	56,600	595.00	33,677,000
フェイス	3,000	511.00	1,533,000
プロトコーポレーション	16,400	1,199.00	19,663,600
ハイマックス	4,200	1,399.00	5,875,800
アミューズ	7,200	1,783.00	12,837,600
野村総合研究所	261,600	3,841.00	1,004,805,600
ドリームインキュベータ	4,200	2,768.00	11,625,600
サイバネットシステム	11,000	825.00	9,075,000
クイック	10,300	2,270.00	23,381,000
T A C	5,200	201.00	1,045,200
C Eホールディングス	5,300	655.00	3,471,500
日本システム技術	4,300	2,342.00	10,070,600
電通グループ	132,200	4,643.00	613,804,600
インテージホールディングス	14,900	1,638.00	24,406,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,600	1,182.00	4,255,200
東邦システムサイエンス	3,000	1,184.00	3,552,000
ぴあ	4,600	3,290.00	15,134,000
イオンファンタジー	5,800	3,155.00	18,299,000
ソースネクスト	66,700	192.00	12,806,400
シーティーエス	14,900	741.00	11,040,900
ネクシィーズグループ	3,400	639.00	2,172,600
インフォコム	17,000	2,244.00	38,148,000
メディカルシステムネットワーク	12,000	369.00	4,428,000
日本精化	7,400	2,969.00	21,970,600
扶桑化学工業	12,200	4,470.00	54,534,000
トリケミカル研究所	17,500	2,714.00	47,495,000
シンプレクス・ホールディングス	22,500	2,560.00	57,600,000
HEROZ	4,500	2,146.00	9,657,000
ラクスル	31,500	1,547.00	48,730,500
メルカリ	79,100	3,473.00	274,714,300
I P S	4,400	2,299.00	10,115,600
F I G	11,800	276.00	3,256,800
システムサポート	5,100	2,029.00	10,347,900
A D E K A	45,800	2,684.00	122,927,200
日油	40,500	6,009.00	243,364,500
ミヨシ油脂	3,600	1,029.00	3,704,400
新日本理化	14,100	244.00	3,440,400
ハリマ化成グループ	7,000	868.00	6,076,000
イーソル	8,300	864.00	7,171,200
アルテリア・ネットワークス	12,300	1,976.00	24,304,800
東海ソフト	1,500	1,097.00	1,645,500
ウイングアーク1 s t	13,600	2,246.00	30,545,600

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,600	1,525.00	5,490,000
サーバーワークス	2,700	2,995.00	8,086,500
東名	800	2,723.00	2,178,400
ヴィッツ	1,100	1,421.00	1,563,100
トピラスシステムズ	2,600	927.00	2,410,200
Sansan	42,900	1,586.50	68,060,850
Link-U	2,500	978.00	2,445,000
ギフトイ	14,300	1,784.00	25,511,200
花王	319,300	5,390.00	1,721,027,000
第一工業製薬	4,800	1,791.00	8,596,800
石原ケミカル	5,900	1,624.00	9,581,600
日華化学	4,200	841.00	3,532,200
ニイタカ	1,900	2,077.00	3,946,300
三洋化成工業	8,000	4,190.00	33,520,000
メドレー	17,600	5,200.00	91,520,000
ベース	4,600	5,340.00	24,564,000
JMDC	21,500	5,477.00	117,755,500
武田薬品工業	1,161,900	4,411.00	5,125,140,900
アステラス製薬	1,240,200	2,049.50	2,541,789,900
住友ファーマ	97,400	666.50	64,917,100
塩野義製薬	165,500	5,738.00	949,639,000
わかもと製薬	9,500	233.00	2,213,500
日本新薬	31,000	5,386.00	166,966,000
中外製薬	410,900	3,822.00	1,570,459,800
科研製薬	22,500	3,501.00	78,772,500
エーザイ	159,600	8,850.00	1,412,460,000
理研ビタミン	11,100	2,015.00	22,366,500
ロート製薬	127,200	2,997.00	381,218,400
小野薬品工業	253,200	2,503.50	633,886,200
久光製薬	29,200	3,692.00	107,806,400
有機合成薬品工業	7,500	302.00	2,265,000
持田製薬	15,100	3,165.00	47,791,500
参天製薬	239,200	1,171.00	280,103,200
扶桑薬品工業	4,200	1,983.00	8,328,600
日本ケミファ	1,100	1,903.00	2,093,300
ツムラ	41,400	2,633.50	109,026,900
テルモ	402,700	4,344.00	1,749,328,800
H. U. グループホールディングス	39,400	2,686.50	105,848,100
キッセイ薬品工業	20,300	2,941.00	59,702,300
生化学工業	25,000	742.00	18,550,000
栄研化学	21,300	1,548.00	32,972,400
鳥居薬品	6,900	3,535.00	24,391,500
JCRファーマ	44,400	1,201.00	53,324,400
東和薬品	20,200	1,713.00	34,602,600
富士製薬工業	9,700	1,122.00	10,883,400
ゼリア新薬工業	18,200	2,311.00	42,060,200
そーせいグループ	45,100	1,526.00	68,822,600
第一三共	1,143,700	3,873.00	4,429,550,100
杏林製薬	28,500	1,703.00	48,535,500

大幸薬品	23,900	349.00	8,341,100
ダイト	9,100	2,160.00	19,656,000
大塚ホールディングス	300,400	5,174.00	1,554,269,600
大正製薬ホールディングス	29,200	5,218.00	152,365,600
ペプチドリーム	63,500	1,931.00	122,618,500
大日本塗料	16,000	927.00	14,832,000
日本ペイントホールディングス	580,200	1,178.50	683,765,700
関西ペイント	120,100	2,111.00	253,531,100
神東塗料	8,700	124.00	1,078,800
中国塗料	21,500	1,174.00	25,241,000
日本特殊塗料	6,400	1,086.00	6,950,400
藤倉化成	17,700	450.00	7,965,000
太陽ホールディングス	20,000	2,627.00	52,540,000
D I C	51,300	2,616.50	134,226,450
サカタインクス	29,200	1,235.00	36,062,000
東洋インキＳＣホールディングス	25,700	2,169.00	55,743,300
T&K TOKA	11,700	1,170.00	13,689,000
アルプス技研	11,700	2,769.00	32,397,300
サニックス	21,500	329.00	7,073,500
日本空調サービス	14,600	754.00	11,008,400
オリエンタルランド	712,100	5,568.00	3,964,972,800
フォーカスシステムズ	9,500	1,018.00	9,671,000
ダスキン	29,900	3,207.00	95,889,300
パーク２４	100,500	1,834.00	184,317,000
明光ネットワークジャパン	16,300	651.00	10,611,300
ファルコホールディングス	6,000	1,845.00	11,070,000
クレスコ	10,100	1,969.00	19,886,900
フジ・メディア・ホールディングス	126,100	1,522.00	191,924,200
秀英予備校	2,400	411.00	986,400
田谷	1,600	483.00	772,800
ラウンドワン	112,500	580.00	65,250,000
リゾートトラスト	53,100	2,173.00	115,386,300
オービック	43,900	22,750.00	998,725,000
ジャストシステム	18,900	4,049.00	76,526,100
TDCソフト	11,000	1,761.00	19,371,000
Zホールディングス	1,868,400	367.00	685,702,800
ビー・エム・エル	16,700	2,763.00	46,142,100
トレンドマイクロ	75,800	6,815.00	516,577,000
IDホールディングス	8,800	1,267.00	11,149,600
リソー教育	61,200	262.00	16,034,400
日本オラクル	25,000	10,175.00	254,375,000
早稲田アカデミー	7,400	1,332.00	9,856,800
アルファシステムズ	4,200	3,355.00	14,091,000
フューチャー	32,700	1,737.00	56,799,900
CAC Holdings	8,000	1,680.00	13,440,000
SBテクノロジー	5,700	2,605.00	14,848,500
トーセ	3,000	742.00	2,226,000
ユー・エス・エス	138,400	2,396.50	331,675,600
オービックビジネスコンサルタント	25,800	5,220.00	134,676,000
伊藤忠テクノソリューションズ	70,500	3,519.00	248,089,500



アイティフォー	17,400	1,087.00	18,913,800
東京個別指導学院	15,900	501.00	7,965,900
東計電算	1,900	6,070.00	11,533,000
サイバーエージェント	297,300	1,040.00	309,192,000
楽天グループ	807,000	536.80	433,197,600
エックスネット	1,500	1,012.00	1,518,000
クリーク・アンド・リバー社	7,800	1,921.00	14,983,800
SBIグローバルアセットマネジメント	22,000	518.00	11,396,000
テー・オー・ダブリュー	26,500	308.00	8,162,000
大塚商会	74,500	5,552.00	413,624,000
サイボウズ	18,000	2,214.00	39,852,000
山田コンサルティンググループ	6,800	1,565.00	10,642,000
セントラルスポーツ	5,100	2,351.00	11,990,100
パラカ	4,700	1,943.00	9,132,100
電通国際情報サービス	15,900	5,210.00	82,839,000
ACCESS	15,500	933.00	14,461,500
デジタルガレージ	23,300	4,060.00	94,598,000
イーエムシステムズ	21,900	836.00	18,308,400
ウェザーニューズ	4,100	6,670.00	27,347,000
C I J	21,800	557.00	12,142,600
ビジネスエンジニアリング	2,200	3,040.00	6,688,000
日本エンタープライズ	10,500	143.00	1,501,500
WOWOW	9,900	1,141.00	11,295,900
スカラ	12,200	744.00	9,076,800
インテリジェント ウェイブ	5,500	756.00	4,158,000
フルキャストホールディングス	12,900	2,315.00	29,863,500
エン・ジャパン	24,300	2,418.00	58,757,400
あすか製薬ホールディングス	13,500	1,433.00	19,345,500
サワイグループホールディングス	30,000	3,544.00	106,320,000
富士フイルムホールディングス	252,000	8,217.00	2,070,684,000
コニカミノルタ	295,300	496.70	146,675,510
資生堂	274,100	6,390.00	1,751,499,000
ライオン	157,500	1,332.50	209,868,750
高砂香料工業	8,800	2,696.00	23,724,800
マンダム	28,400	1,384.00	39,305,600
ミルボン	19,500	4,995.00	97,402,500
ファンケル	57,500	2,576.00	148,120,000
コーセー	26,700	13,640.00	364,188,000
コタ	12,100	1,613.00	19,517,300
シーボン	1,300	1,551.00	2,016,300
ポーラ・オルビスホールディングス	67,300	2,123.50	142,911,550
ノエビアホールディングス	11,700	5,500.00	64,350,000
アジュバンホールディングス	2,500	935.00	2,337,500
新日本製薬	7,400	1,419.00	10,500,600
アクシージア	6,600	1,353.00	8,929,800
エステー	10,200	1,504.00	15,340,800
アグロ カネショウ	5,300	1,612.00	8,543,600
コニシ	21,900	2,170.00	47,523,000
長谷川香料	25,000	3,435.00	85,875,000

星光PMC	5,300	573.00	3,036,900
小林製薬	38,200	7,661.00	292,650,200
荒川化学工業	11,100	991.00	11,000,100
メック	10,700	3,675.00	39,322,500
日本高純度化学	3,400	2,515.00	8,551,000
タカラバイオ	35,300	1,614.00	56,974,200
JCU	14,700	3,355.00	49,318,500
新田ゼラチン	6,200	742.00	4,600,400
OATアグリオ	4,300	1,919.00	8,251,700
デクセリアルズ	35,900	3,166.00	113,659,400
アース製薬	11,900	5,040.00	59,976,000
北興化学工業	13,200	871.00	11,497,200
大成ラミック	4,200	2,931.00	12,310,200
クミアイ化学工業	52,100	1,060.00	55,226,000
日本農薬	24,000	703.00	16,872,000
富士興産	2,500	1,580.00	3,950,000
ニチレキ	15,500	1,921.00	29,775,500
ユシロ化学工業	6,800	1,075.00	7,310,000
ビービー・カストロール	4,000	871.00	3,484,000
富士石油	26,800	277.00	7,423,600
MORESCO	3,500	1,180.00	4,130,000
出光興産	145,800	2,906.00	423,694,800
ENEOSホールディングス	2,227,100	493.50	1,099,073,850
コスモエネルギーホールディングス	52,000	3,929.00	204,308,000
テスホールディングス	27,600	655.00	18,078,000
インフロニア・ホールディングス	134,400	1,329.00	178,617,600
横浜ゴム	74,800	3,014.00	225,447,200
TOYO TIRE	75,400	1,857.00	140,017,800
ブリヂストン	419,300	5,738.00	2,405,943,400
住友ゴム工業	128,800	1,380.50	177,808,400
藤倉コンポジット	7,100	948.00	6,730,800
オカモト	7,200	3,860.00	27,792,000
アキレス	8,300	1,435.00	11,910,500
フコク	6,900	1,458.00	10,060,200
ニッタ	13,400	3,100.00	41,540,000
クリエートメディック	3,500	886.00	3,101,000
住友理工	25,500	819.00	20,884,500
三ツ星ベルト	19,200	4,360.00	83,712,000
バンドー化学	20,800	1,455.00	30,264,000
AGC	133,600	4,897.00	654,239,200
日本板硝子	66,900	626.00	41,879,400
石塚硝子	1,600	1,597.00	2,555,200
有沢製作所	21,300	1,093.00	23,280,900
日本山村硝子	3,900	1,068.00	4,165,200
日本電気硝子	53,500	2,503.00	133,910,500
オハラ	6,100	1,399.00	8,533,900
住友大阪セメント	18,500	3,635.00	67,247,500
太平洋セメント	83,600	2,715.50	227,015,800
リソルホールディングス	1,000	4,715.00	4,715,000
日本ヒューム	11,500	740.00	8,510,000

日本コンクリート工業	25,600	321.00	8,217,600
三谷セキサン	5,600	4,510.00	25,256,000
アジアパイルホールディングス	20,500	607.00	12,443,500
東海カーボン	110,000	1,233.00	135,630,000
日本カーボン	7,400	4,230.00	31,302,000
東洋炭素	8,200	5,180.00	42,476,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,500	5,450.00	35,425,000
TOTO	86,800	4,217.00	366,035,600
日本碍子	152,700	1,690.50	258,139,350
日本特殊陶業	100,000	2,912.50	291,250,000
ダントーホールディングス	7,100	754.00	5,353,400
MARUWA	4,900	22,050.00	108,045,000
品川リフラクトリーズ	3,800	5,690.00	21,622,000
黒崎播磨	2,800	8,930.00	25,004,000
ヨータイ	7,000	1,468.00	10,276,000
東京窯業	9,300	339.00	3,152,700
ニッカトー	4,700	653.00	3,069,100
フジミインコーポレーテッド	31,400	3,470.00	108,958,000
クニミネ工業	3,100	1,017.00	3,152,700
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,092.00	2,074,800
ニチアス	33,300	2,857.00	95,138,100
日本製鉄	604,900	2,945.50	1,781,732,950
神戸製鋼所	271,800	1,322.50	359,455,500
中山製鋼所	27,800	855.00	23,769,000
合同製鐵	6,700	3,605.00	24,153,500
JFEホールディングス	361,000	1,987.50	717,487,500
東京製鐵	38,000	1,325.00	50,350,000
共英製鋼	15,500	1,945.00	30,147,500
大和工業	22,300	6,117.00	136,409,100
東京鐵鋼	6,400	3,165.00	20,256,000
大阪製鐵	6,200	1,387.00	8,599,400
淀川製鋼所	15,500	3,270.00	50,685,000
中部鋼板	11,100	1,905.00	21,145,500
丸一鋼管	41,200	3,218.00	132,581,600
モリ工業	2,500	3,380.00	8,450,000
大同特殊鋼	17,100	5,888.00	100,684,800
日本高周波鋼業	3,800	358.00	1,360,400
日本冶金工業	9,800	4,165.00	40,817,000
山陽特殊製鋼	13,400	2,667.00	35,737,800
愛知製鋼	7,800	3,175.00	24,765,000
日本金属	2,400	952.00	2,284,800
大太平洋金属	9,600	1,558.00	14,956,800
新日本電工	80,600	281.00	22,648,600
栗本鐵工所	6,400	2,312.00	14,796,800
虹 技	1,300	1,214.00	1,578,200
日本鑄鉄管	1,200	1,065.00	1,278,000
日本製鋼所	36,400	2,963.50	107,871,400
三菱製鋼	8,400	1,466.00	12,314,400
日亜鋼業	10,900	313.00	3,411,700
日本精線	1,900	4,820.00	9,158,000

エンビプロ・ホールディングス	7,100	525.00	3,727,500
大紀アルミニウム工業所	19,300	1,450.00	27,985,000
日本軽金属ホールディングス	36,500	1,455.00	53,107,500
三井金属鉱業	39,300	3,239.00	127,292,700
東邦亜鉛	7,900	1,718.00	13,572,200
三菱マテリアル	90,100	2,490.50	224,394,050
住友金属鉱山	156,600	4,700.00	736,020,000
DOWAホールディングス	30,300	4,497.00	136,259,100
古河機械金属	20,000	1,528.00	30,560,000
エス・サイエンス	63,500	24.00	1,524,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,900	2,960.00	58,904,000
東邦チタニウム	24,400	1,640.00	40,016,000
UACJ	18,900	2,677.00	50,595,300
CKサンエツ	2,600	4,150.00	10,790,000
古河電気工業	44,900	2,561.00	114,988,900
住友電気工業	466,400	1,692.00	789,148,800
フジクラ	144,900	1,165.50	168,880,950
SWCC	15,100	1,905.00	28,765,500
タツタ電線	27,500	708.00	19,470,000
カナレ電気	1,600	1,364.00	2,182,400
平河ヒューテック	7,700	1,564.00	12,042,800
いよぎんホールディングス	153,400	821.90	126,079,460
しずおかフィナンシャルグループ	286,500	1,057.00	302,830,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	108,600	878.00	95,350,800
楽天銀行	43,700	1,896.00	82,855,200
リョービ	14,400	2,165.00	31,176,000
アーレスティ	11,600	686.00	7,957,600
AREホールディングス	54,600	1,928.00	105,268,800
東洋製罐グループホールディングス	80,600	2,118.50	170,751,100
ホッカンホールディングス	7,200	1,371.00	9,871,200
コロナ	7,500	902.00	6,765,000
横河ブリッジホールディングス	17,000	2,552.00	43,384,000
駒井ハルテック	1,700	1,875.00	3,187,500
高田機工	600	2,678.00	1,606,800
三和ホールディングス	124,400	1,838.50	228,709,400
文化シャッター	39,000	1,072.00	41,808,000
三協立山	15,500	801.00	12,415,500
アルインコ	10,300	992.00	10,217,600
東洋シャッター	2,200	621.00	1,366,200
LIXIL	196,700	1,814.50	356,912,150
日本ファイルコン	6,900	466.00	3,215,400
ノーリツ	20,000	1,670.00	33,400,000
長府製作所	13,700	2,506.00	34,332,200
リンナイ	73,500	3,039.00	223,366,500
ユニプレス	23,500	1,126.00	26,461,000
ダイニチ工業	5,300	738.00	3,911,400
日東精工	19,600	606.00	11,877,600
三洋工業	1,200	2,004.00	2,404,800
岡部	21,700	725.00	15,732,500
ジーテクト	15,100	1,757.00	26,530,700

東プレ	23,800	1,541.00	36,675,800
高周波熱錬	20,800	976.00	20,300,800
東京製鋼	7,900	1,160.00	9,164,000
サンコー	9,300	523.00	4,863,900
モリテックスチール	7,700	299.00	2,302,300
パイオラックス	18,600	2,173.00	40,417,800
エイチワン	13,900	806.00	11,203,400
日本発条	119,500	1,014.50	121,232,750
中央発条	10,000	695.00	6,950,000
アドバネクス	1,300	995.00	1,293,500
三浦工業	55,200	3,623.00	199,989,600
タクマ	40,600	1,458.00	59,194,800
テクノプロ・ホールディングス	79,700	3,088.00	246,113,600
アトラグループ	2,500	179.00	447,500
インターワークス	2,900	334.00	968,600
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	1,721.00	11,874,900
Keepers 技研	8,300	5,870.00	48,721,000
ファーストロジック	1,200	986.00	1,183,200
三機サービス	1,600	1,154.00	1,846,400
Gunosy	10,700	624.00	6,676,800
デザインワン・ジャパン	2,700	180.00	486,000
イー・ガーディアン	5,100	2,087.00	10,643,700
リブセンス	4,800	290.00	1,392,000
ジャパンマテリアル	41,200	2,319.00	95,542,800
ベクトル	21,100	1,254.00	26,459,400
ウチヤマホールディングス	4,700	351.00	1,649,700
チャーム・ケア・コーポレーション	11,200	1,291.00	14,459,200
キャリアリンク	5,000	2,860.00	14,300,000
I B J	8,200	655.00	5,371,000
アサンテ	6,600	1,699.00	11,213,400
バリューHR	11,800	1,278.00	15,080,400
M&Aキャピタルパートナーズ	10,800	3,110.00	33,588,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,036.00	4,972,800
ERIホールディングス	2,800	1,330.00	3,724,000
アビスト	1,700	3,255.00	5,533,500
シグマクス・ホールディングス	20,400	1,317.00	26,866,800
ウィルグループ	11,200	1,094.00	12,252,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,000	143.00	1,573,000
メドピア	11,800	984.00	11,611,200
レアジョブ	2,100	1,006.00	2,112,600
リクルートホールディングス	996,400	4,482.00	4,465,864,800
エラン	17,800	848.00	15,094,400
ツガミ	29,400	1,318.00	38,749,200
オークマ	13,200	7,284.00	96,148,800
芝浦機械	13,200	4,560.00	60,192,000
アマダ	211,000	1,373.00	289,703,000
アイダエンジニアリング	27,300	956.00	26,098,800
TAKISAWA	2,800	1,405.00	3,934,000

F U J I	57,500	2,583.00	148,522,500
牧野フライス製作所	14,600	5,450.00	79,570,000
オーエスジー	63,000	1,893.00	119,259,000
ダイジェット工業	1,100	893.00	982,300
旭ダイヤモンド工業	36,900	885.00	32,656,500
DMG森精機	80,100	2,394.50	191,799,450
ソディック	36,400	708.00	25,771,200
ディスコ	63,500	23,260.00	1,477,010,000
日東工器	6,400	1,906.00	12,198,400
日進工具	11,000	1,094.00	12,034,000
パンチ工業	9,200	485.00	4,462,000
富士ダイス	4,800	660.00	3,168,000
土木管理総合試験所	4,500	338.00	1,521,000
日本郵政	1,619,200	1,038.50	1,681,539,200
ベルシステム24ホールディングス	18,000	1,350.00	24,300,000
鎌倉新書	15,300	705.00	10,786,500
SMN	2,600	449.00	1,167,400
一蔵	1,300	599.00	778,700
グローバルキッズCOMPANY	2,000	670.00	1,340,000
エアトリ	9,800	2,709.00	26,548,200
アトラエ	7,900	769.00	6,075,100
ストライク	5,800	3,365.00	19,517,000
ソラスト	37,000	645.00	23,865,000
セラク	4,200	1,562.00	6,560,400
インソース	29,200	1,181.00	34,485,200
豊田自動織機	95,800	9,878.00	946,312,400
豊和工業	5,700	797.00	4,542,900
石川製作所	2,700	1,363.00	3,680,100
東洋機械金属	7,000	680.00	4,760,000
津田駒工業	1,900	434.00	824,600
エンシュウ	2,200	781.00	1,718,200
島精機製作所	21,000	1,826.00	38,346,000
オプトラン	19,600	2,249.00	44,080,400
NCホールディングス	2,100	2,182.00	4,582,200
イワキ	8,700	1,371.00	11,927,700
フリーー	13,900	1,278.00	17,764,200
ヤマシンフィルタ	31,600	304.00	9,606,400
日阪製作所	12,900	935.00	12,061,500
やまびこ	21,600	1,541.00	33,285,600
野村マイクロ・サイエンス	4,600	6,370.00	29,302,000
平田機工	6,300	8,100.00	51,030,000
PEGASUS	14,600	571.00	8,336,600
マルマエ	5,800	1,721.00	9,981,800
タツモ	7,100	2,261.00	16,053,100
ナブテスコ	82,900	3,099.00	256,907,100
三井海洋開発	16,600	1,511.00	25,082,600
レオン自動機	14,000	1,410.00	19,740,000
SMC	42,900	76,630.00	3,287,427,000
ホソカワミクロン	8,400	3,430.00	28,812,000
ユニオンツール	5,800	3,280.00	19,024,000

瑞光	9,500	1,152.00	10,944,000
オイレス工業	18,500	1,909.00	35,316,500
日精エー・エス・ビー機械	5,300	4,090.00	21,677,000
サトーホールディングス	18,800	1,915.00	36,002,000
技研製作所	12,500	1,951.00	24,387,500
日本エアータック	6,600	1,204.00	7,946,400
カワタ	3,100	1,110.00	3,441,000
日精樹脂工業	9,800	981.00	9,613,800
オカダアイヨン	3,300	2,262.00	7,464,600
ワイエイシイホールディングス	4,400	2,693.00	11,849,200
小松製作所	619,400	3,678.00	2,278,153,200
住友重機械工業	78,200	3,326.00	260,093,200
日立建機	52,600	3,856.00	202,825,600
日工	19,600	665.00	13,034,000
巴工業	5,800	2,820.00	16,356,000
井関農機	12,400	1,234.00	15,301,600
TOWA	13,500	2,509.00	33,871,500
丸山製作所	1,800	1,946.00	3,502,800
北川鉄工所	5,200	1,124.00	5,844,800
シンニッタン	11,300	253.00	2,858,900
ローツェ	6,900	11,650.00	80,385,000
タカキタ	3,000	483.00	1,449,000
クボタ	699,600	2,044.00	1,429,982,400
荏原実業	6,300	2,811.00	17,709,300
東洋エンジニアリング	17,100	584.00	9,986,400
三菱化工機	4,300	2,660.00	11,438,000
月島ホールディングス	17,800	1,260.00	22,428,000
帝国電機製作所	9,200	2,610.00	24,012,000
東京機械製作所	2,500	471.00	1,177,500
新東工業	26,700	1,044.00	27,874,800
澁谷工業	12,500	2,547.00	31,837,500
アイチコーポレーション	18,400	855.00	15,732,000
小森コーポレーション	30,600	987.00	30,202,200
鶴見製作所	10,100	2,657.00	26,835,700
日本ギア工業	3,600	369.00	1,328,400
酒井重工業	1,700	5,010.00	8,517,000
荏原製作所	54,000	6,809.00	367,686,000
石井鐵工所	1,000	2,494.00	2,494,000
西島製作所	11,400	1,866.00	21,272,400
北越工業	13,300	1,441.00	19,165,300
ダイキン工業	157,800	28,695.00	4,528,071,000
オルガノ	18,100	4,085.00	73,938,500
トーヨーカネツ	5,100	3,580.00	18,258,000
栗田工業	74,000	5,440.00	402,560,000
樺本チエイン	18,700	3,675.00	68,722,500
大同工業	4,200	733.00	3,078,600
日機装	30,500	878.00	26,779,000
木村化工機	10,100	709.00	7,160,900
レイズネクスト	18,600	1,435.00	26,691,000
アネスト岩田	22,500	1,178.00	26,505,000

ダイフク	204,500	2,921.00	597,344,500
サムコ	3,600	5,480.00	19,728,000
加藤製作所	4,900	1,182.00	5,791,800
油研工業	1,600	2,017.00	3,227,200
タダノ	69,800	1,102.50	76,954,500
フジテック	46,400	3,597.00	166,900,800
CKD	36,600	2,232.00	81,691,200
平和	44,000	2,440.00	107,360,000
理想科学工業	10,600	2,318.00	24,570,800
SANKYO	26,000	5,650.00	146,900,000
日本金銭機械	14,500	1,152.00	16,704,000
マースグループホールディングス	7,700	2,799.00	21,552,300
フクシマガリレイ	9,700	4,825.00	46,802,500
オーイズミ	3,900	503.00	1,961,700
ダイコク電機	7,100	4,140.00	29,394,000
竹内製作所	23,900	4,425.00	105,757,500
アマノ	37,500	2,953.50	110,756,250
JUKI	20,500	579.00	11,869,500
サンデン	15,300	196.00	2,998,800
ジャノメ	13,400	648.00	8,683,200
ブラザー工業	176,600	2,085.00	368,211,000
マックス	16,300	2,621.00	42,722,300
モリタホールディングス	23,000	1,532.00	35,236,000
グローリー	31,800	2,762.00	87,831,600
新晃工業	13,300	2,002.00	26,626,600
大和冷機工業	20,200	1,388.00	28,037,600
セガサミーホールディングス	106,300	2,989.00	317,730,700
日本ピストンリング	3,600	1,675.00	6,030,000
リケン	5,300	3,280.00	17,384,000
T P R	15,100	1,734.00	26,183,400
ツバキ・ナカシマ	32,700	808.00	26,421,600
ホシザキ	85,100	5,094.00	433,499,400
大豊工業	11,400	877.00	9,997,800
日本精工	242,900	888.90	215,913,810
NTN	260,500	301.20	78,462,600
ジェイテクト	117,700	1,281.50	150,832,550
不二越	9,700	4,120.00	39,964,000
ミネベアミツミ	229,900	2,508.00	576,589,200
日本トムソン	32,400	586.00	18,986,400
THK	76,200	2,817.50	214,693,500
ユーシン精機	10,500	706.00	7,413,000
前澤給装工業	9,200	1,125.00	10,350,000
イーグル工業	14,600	1,745.00	25,477,000
前澤工業	5,900	798.00	4,708,200
日本ピラー工業	12,300	4,515.00	55,534,500
キッツ	48,700	1,057.00	51,475,900
日立製作所	643,000	8,838.00	5,682,834,000
東芝	254,500	4,510.00	1,147,795,000
三菱電機	1,366,500	2,002.50	2,736,416,250
富士電機	80,400	5,956.00	478,862,400



東洋電機製造	3,400	947.00	3,219,800
安川電機	156,700	6,081.00	952,892,700
シンフォニアテクノロジー	14,600	1,692.00	24,703,200
明電舎	20,100	2,024.00	40,682,400
オリジン	2,400	1,292.00	3,100,800
山洋電気	5,800	7,520.00	43,616,000
デンヨー	10,100	1,989.00	20,088,900
PHCホールディングス	18,400	1,475.00	27,140,000
ソシオネクスト	18,600	15,280.00	284,208,000
ベイカレント・コンサルティング	106,500	5,197.00	553,480,500
Orchestra Holdings	3,000	1,173.00	3,519,000
アイモバイル	5,900	1,310.00	7,729,000
キャリアインデックス	3,600	307.00	1,105,200
MS-Japan	3,600	1,150.00	4,140,000
船場	1,400	755.00	1,057,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,000	1,846.00	88,608,000
フルテック	1,500	1,109.00	1,663,500
グリーンズ	3,600	1,428.00	5,140,800
ツナググループ・ホールディングス	3,000	613.00	1,839,000
GAMEWITH	3,200	357.00	1,142,400
MS&Consulting	1,200	608.00	729,600
ウェルビー	9,800	448.00	4,390,400
エル・ティイー・エス	1,700	3,680.00	6,256,000
ミダックホールディングス	8,100	1,769.00	14,328,900
日総工産	10,100	890.00	8,989,000
キュービーネットホールディングス	6,300	1,485.00	9,355,500
RPAホールディングス	18,200	405.00	7,371,000
三櫻工業	20,000	840.00	16,800,000
マキタ	164,500	3,885.00	639,082,500
東芝テック	19,800	3,885.00	76,923,000
芝浦メカトロニクス	2,300	22,060.00	50,738,000
マブチモーター	32,900	3,823.00	125,776,700
ニデック	321,700	7,473.00	2,404,064,100
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,700	524.00	5,082,800
トレックス・セミコンダクター	6,100	2,337.00	14,255,700
東光高岳	7,900	2,135.00	16,866,500
ダブル・スコープ	43,200	1,286.00	55,555,200
宮越ホールディングス	5,900	848.00	5,003,200
ダイヘン	12,000	5,450.00	65,400,000
ヤーマン	22,800	1,016.00	23,164,800
JVCケンウッド	120,300	477.00	57,383,100
ミマキエンジニアリング	12,600	908.00	11,440,800
I-PEX	7,200	1,311.00	9,439,200
大崎電気工業	31,400	545.00	17,113,000
オムロン	121,100	8,597.00	1,041,096,700
日東工業	17,800	3,535.00	62,923,000
IDEC	19,600	3,150.00	61,740,000
正興電機製作所	3,900	1,049.00	4,091,100

不二電機工業	2,100	1,179.00	2,475,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	43,400	2,813.50	122,105,900
サクサホールディングス	2,200	2,128.00	4,681,600
メルコホールディングス	3,500	3,170.00	11,095,000
テクノメディア	3,300	1,990.00	6,567,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,600	821.00	3,776,600
日本電気	186,900	6,785.00	1,268,116,500
富士通	131,800	18,105.00	2,386,239,000
沖電気工業	59,900	880.00	52,712,000
岩崎通信機	4,600	766.00	3,523,600
電気興業	5,400	2,317.00	12,511,800
サンケン電気	12,300	12,540.00	154,242,000
ナカヨ	1,700	1,137.00	1,932,900
アイホン	8,000	2,414.00	19,312,000
ルネサスエレクトロニクス	862,700	2,662.50	2,296,938,750
セイコーエプソン	169,600	2,179.50	369,643,200
ワコム	100,500	596.00	59,898,000
アルバック	31,500	5,910.00	186,165,000
アクセル	3,900	1,659.00	6,470,100
E I Z O	9,600	4,570.00	43,872,000
ジャパンディスプレイ	507,700	38.00	19,292,600
日本信号	30,100	1,032.00	31,063,200
京三製作所	27,700	505.00	13,988,500
能美防災	17,800	1,727.00	30,740,600
ホーチキ	9,900	1,721.00	17,037,900
星和電機	4,200	540.00	2,268,000
エレコム	31,700	1,483.00	47,011,100
パナソニック ホールディングス	1,561,700	1,663.50	2,597,887,950
シャープ	159,200	788.40	125,513,280
アンリツ	93,100	1,234.00	114,885,400
富士通ゼネラル	37,400	3,131.00	117,099,400
ソニーグループ	926,100	12,675.00	11,738,317,500
TDK	209,400	5,289.00	1,107,516,600
帝国通信工業	5,900	1,642.00	9,687,800
タムラ製作所	56,700	633.00	35,891,100
アルプスアルパイン	118,100	1,215.50	143,550,550
池上通信機	3,400	689.00	2,342,600
日本電波工業	15,800	1,193.00	18,849,400
鈴木	7,000	923.00	6,461,000
メイコー	14,400	2,604.00	37,497,600
日本トリム	3,100	3,280.00	10,168,000
ローランド ディー. ジー.	7,100	3,600.00	25,560,000
フォスター電機	12,300	916.00	11,266,800
SMK	3,300	2,452.00	8,091,600
ヨコオ	10,500	1,845.00	19,372,500
ティアック	15,800	115.00	1,817,000
ホシデン	30,900	1,708.00	52,777,200
ヒロセ電機	21,300	18,340.00	390,642,000
日本航空電子工業	27,200	3,020.00	82,144,000

TOA	15,100	950.00	14,345,000
マクセル	26,800	1,570.00	42,076,000
古野電気	17,300	1,071.00	18,528,300
スミダコーポレーション	12,100	1,506.00	18,222,600
アイコム	5,100	2,779.00	14,172,900
リオン	5,500	1,892.00	10,406,000
横河電機	144,600	2,655.50	383,985,300
新電元工業	5,100	3,200.00	16,320,000
アズビル	91,400	4,461.00	407,735,400
東亜ディーケーケー	4,900	840.00	4,116,000
日本光電工業	60,600	3,700.00	224,220,000
チノー	5,500	2,317.00	12,743,500
共和電業	9,500	361.00	3,429,500
日本電子材料	8,500	1,845.00	15,682,500
堀場製作所	29,100	8,124.00	236,408,400
アドバンテスト	103,200	20,300.00	2,094,960,000
小野測器	3,900	492.00	1,918,800
エスペック	10,500	2,300.00	24,150,000
キーエンス	131,000	65,790.00	8,618,490,000
日置電機	6,800	8,960.00	60,928,000
シスメックス	112,900	9,318.00	1,052,002,200
日本マイクロニクス	21,500	2,128.00	45,752,000
メガチップス	10,700	3,780.00	40,446,000
OBARA GROUP	7,100	4,090.00	29,039,000
IMAGICA GROUP	10,900	677.00	7,379,300
澤藤電機	1,200	1,207.00	1,448,400
デンソー	270,100	9,272.00	2,504,367,200
原田工業	4,600	810.00	3,726,000
コーセル	15,700	1,229.00	19,295,300
イリソ電子工業	12,100	3,985.00	48,218,500
オブテックスグループ	24,000	1,960.00	47,040,000
千代田インテグレ	4,700	2,392.00	11,242,400
レーザーテック	60,100	21,045.00	1,264,804,500
スタンレー電気	93,100	2,669.50	248,530,450
ウシオ電機	66,500	1,912.50	127,181,250
岡谷電機産業	7,800	273.00	2,129,400
ヘリオス テクノ ホールディング	9,300	558.00	5,189,400
エノモト	2,700	1,748.00	4,719,600
日本セラミック	13,300	2,630.00	34,979,000
遠藤照明	4,700	1,212.00	5,696,400
古河電池	9,600	1,009.00	9,686,400
双信電機	4,200	356.00	1,495,200
山一電機	10,700	2,291.00	24,513,700
図研	11,400	3,790.00	43,206,000
日本電子	32,800	4,813.00	157,866,400
カシオ計算機	97,600	1,171.50	114,338,400
ファナック	638,400	4,768.00	3,043,891,200
日本シイエムケイ	27,800	526.00	14,622,800
エンプラス	3,900	5,400.00	21,060,000
大真空	15,900	648.00	10,303,200

ローム	60,600	13,615.00	825,069,000
浜松ホトニクス	105,000	6,896.00	724,080,000
三井ハイテック	13,500	9,130.00	123,255,000
新光電気工業	46,400	5,780.00	268,192,000
京セラ	203,300	7,552.00	1,535,321,600
協栄産業	1,100	1,988.00	2,186,800
太陽誘電	63,600	4,167.00	265,021,200
村田製作所	397,000	8,010.00	3,179,970,000
双葉電子工業	24,900	493.00	12,275,700
日東電工	95,300	9,963.00	949,473,900
北陸電気工業	3,900	1,199.00	4,676,100
東海理化電機製作所	36,900	2,105.00	77,674,500
ニチコン	26,800	1,449.00	38,833,200
日本ケミコン	13,000	1,261.00	16,393,000
KOA	19,900	1,806.00	35,939,400
三井E&S	61,600	508.00	31,292,800
日立造船	108,300	906.00	98,119,800
三菱重工業	231,200	6,451.00	1,491,471,200
川崎重工業	98,700	3,551.00	350,483,700
IHI	83,300	3,758.00	313,041,400
名村造船所	26,100	605.00	15,790,500
サノヤスホールディングス	13,700	141.00	1,931,700
スプリックス	3,100	785.00	2,433,500
マネジメントソリューションズ	7,300	3,915.00	28,579,500
プロレド・パートナーズ	3,300	507.00	1,673,100
and factory	3,200	432.00	1,382,400
テノ・ホールディングス	1,300	675.00	877,500
フロンティア・マネジメント	4,600	1,379.00	6,343,400
ピアラ	1,700	482.00	819,400
コプロ・ホールディングス	1,700	2,011.00	3,418,700
ギークス	1,500	723.00	1,084,500
アンビスホールディングス	14,400	2,904.00	41,817,600
カーブスホールディングス	36,800	749.00	27,563,200
フォーラムエンジニアリング	7,800	1,173.00	9,149,400
FAST FITNESS JAPAN	4,700	1,356.00	6,373,200
日本車輛製造	5,100	1,996.00	10,179,600
三菱ロジスネクスト	20,800	1,247.00	25,937,600
近畿車輛	1,400	1,645.00	2,303,000
一家ホールディングス	2,500	668.00	1,670,000
フルサト・マルカホールディングス	13,800	2,500.00	34,500,000
ヤマエグループホールディングス	7,800	2,898.00	22,604,400
ジャパクラフトホールディングス	6,500	244.00	1,586,000
FPG	43,600	1,293.00	56,374,800
島根銀行	3,600	485.00	1,746,000
じもとホールディングス	8,800	394.00	3,467,200
全国保証	33,700	4,934.00	166,275,800
めぶきフィナンシャルグループ	639,700	338.90	216,794,330
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,600	1,175.00	12,455,000

東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,500	3,290.00	54,285,000
九州フィナンシャルグループ	226,800	637.40	144,562,320
かんぽ生命保険	150,100	2,227.00	334,272,700
ゆうちょ銀行	354,200	1,133.50	401,485,700
あんしん保証	5,000	305.00	1,525,000
富山第一銀行	41,000	758.00	31,078,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	691,800	582.30	402,835,140
ジェイリース	3,500	2,303.00	8,060,500
西日本フィナンシャルホールディングス	80,000	1,402.00	112,160,000
イントラスト	3,900	915.00	3,568,500
日本モーゲージサービス	5,600	572.00	3,203,200
CASA	4,000	937.00	3,748,000
アルヒ	15,900	984.00	15,645,600
プレミアグループ	21,700	1,738.00	37,714,600
日産自動車	1,859,600	569.90	1,059,786,040
いすゞ自動車	380,600	1,730.00	658,438,000
トヨタ自動車	7,188,200	2,211.00	15,893,110,200
日野自動車	168,700	596.50	100,629,550
三菱自動車工業	510,600	516.20	263,571,720
エフテック	6,900	911.00	6,285,900
レシップホールディングス	4,100	537.00	2,201,700
GMB	2,000	1,517.00	3,034,000
ファルテック	1,700	611.00	1,038,700
武蔵精密工業	32,100	1,708.00	54,826,800
日産車体	23,100	905.00	20,905,500
新明和工業	41,100	1,321.00	54,293,100
極東開発工業	21,600	1,728.00	37,324,800
トビー工業	10,600	2,240.00	23,744,000
ティラド	3,400	1,840.00	6,256,000
曙ブレーキ工業	79,800	144.00	11,491,200
タチエス	20,700	1,527.00	31,608,900
NOK	50,900	2,061.50	104,930,350
フタバ産業	35,000	553.00	19,355,000
KYB	12,700	4,930.00	62,611,000
市光工業	18,800	517.00	9,719,600
大同メタル工業	25,600	533.00	13,644,800
プレス工業	58,500	616.00	36,036,000
ミクニ	11,700	490.00	5,733,000
太平洋工業	30,000	1,313.00	39,390,000
河西工業	13,500	165.00	2,227,500
アイシン	101,000	4,471.00	451,571,000
マツダ	433,100	1,305.00	565,195,500
今仙電機製作所	6,400	625.00	4,000,000
本田技研工業	1,064,100	4,184.00	4,452,194,400
スズキ	240,500	5,386.00	1,295,333,000
SUBARU	414,200	2,533.50	1,049,375,700
安永	4,500	940.00	4,230,000
ヤマハ発動機	205,700	3,991.00	820,948,700

小糸製作所	157,500	2,480.50	390,678,750
T B K	10,100	405.00	4,090,500
エクセディ	21,400	2,378.00	50,889,200
ミツバ	24,500	799.00	19,575,500
豊田合成	38,200	2,702.00	103,216,400
愛三工業	21,600	1,128.00	24,364,800
盟和産業	1,400	1,014.00	1,419,600
日本プラスト	7,900	462.00	3,649,800
ヨロズ	12,300	920.00	11,316,000
エフ・シー・シー	23,200	1,869.00	43,360,800
新家工業	2,300	2,354.00	5,414,200
シマノ	53,200	24,295.00	1,292,494,000
テイ・エス テック	60,000	1,825.00	109,500,000
三十三フィナンシャルグループ	11,500	1,619.00	18,618,500
第四北越フィナンシャルグループ	20,200	3,180.00	64,236,000
ひろぎんホールディングス	168,100	840.70	141,321,670
マーキュリアホールディングス	5,900	789.00	4,655,100
おきなわフィナンシャルグループ	12,300	2,147.00	26,408,100
ダイレクトマーケティングミックス	16,100	875.00	14,087,500
ポピンズ	2,000	1,414.00	2,828,000
L I T A L I C O	10,500	2,215.00	23,257,500
十六フィナンシャルグループ	16,700	3,145.00	52,521,500
北國フィナンシャルホールディングス	13,500	4,330.00	58,455,000
ネットプロテクションズホールディングス	42,700	333.00	14,219,100
プロクレアホールディングス	15,800	2,082.00	32,895,600
あいちフィナンシャルグループ	18,000	2,230.00	40,140,000
ジャムコ	5,600	1,519.00	8,506,400
小野建	13,700	1,628.00	22,303,600
はるやまホールディングス	4,600	503.00	2,313,800
南陽	2,100	2,146.00	4,506,600
ノジマ	45,200	1,368.00	61,833,600
佐島電機	6,700	1,632.00	10,934,400
カップ・クリエイト	21,800	1,518.00	33,092,400
エコートレーディング	2,100	1,142.00	2,398,200
伯東	7,900	5,610.00	44,319,000
コンドーテック	10,700	1,211.00	12,957,700
中山福	5,800	344.00	1,995,200
ライトオン	8,100	616.00	4,989,600
ナガイレーベン	17,500	2,223.00	38,902,500
三菱食品	12,900	3,690.00	47,601,000
良品計画	151,100	1,713.00	258,834,300
パリミキホールディングス	13,500	326.00	4,401,000
松田産業	10,600	2,253.00	23,881,800
第一興商	53,500	2,715.00	145,252,500
メディバルホールディングス	132,400	2,283.00	302,269,200
アドヴァングループ	13,200	994.00	13,120,800
S P K	6,100	1,765.00	10,766,500
萩原電気ホールディングス	5,400	3,420.00	18,468,000
アルビス	4,700	2,404.00	11,298,800

アズワン	19,800	5,473.00	108,365,400
スズデン	4,900	2,205.00	10,804,500
尾家産業	2,600	1,288.00	3,348,800
シモジマ	9,500	1,066.00	10,127,000
ドウシシャ	14,700	2,229.00	32,766,300
小津産業	2,400	1,565.00	3,756,000
コナカ	11,600	400.00	4,640,000
高速	7,100	2,005.00	14,235,500
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,610.00	2,254,000
G-7ホールディングス	17,300	1,238.00	21,417,400
たけびし	5,300	1,704.00	9,031,200
イオン北海道	20,500	879.00	18,019,500
コジマ	22,800	612.00	13,953,600
ヒマラヤ	3,500	967.00	3,384,500
コーナン商事	18,700	3,490.00	65,263,000
ネットワンシステムズ	48,900	3,006.00	146,993,400
エコス	5,200	1,957.00	10,176,400
ワタミ	16,800	887.00	14,901,600
マルシェ	3,600	257.00	925,200
リックス	2,300	3,055.00	7,026,500
システムソフト	45,600	81.00	3,693,600
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	279,600	2,658.00	743,176,800
丸文	12,400	1,256.00	15,574,400
西松屋チェーン	30,700	1,633.00	50,133,100
ゼンショーホールディングス	75,800	6,525.00	494,595,000
ハピネット	11,800	2,153.00	25,405,400
幸楽苑ホールディングス	8,900	1,017.00	9,051,300
ハークスレイ	3,800	658.00	2,500,400
橋本総業ホールディングス	5,600	1,196.00	6,697,600
日本ライフライン	40,600	978.00	39,706,800
サイゼリヤ	20,500	3,560.00	72,980,000
タカショー	12,100	681.00	8,240,100
VTホールディングス	52,500	532.00	27,930,000
アルゴグラフィックス	12,100	3,680.00	44,528,000
魚力	4,400	2,195.00	9,658,000
IDOM	41,800	968.00	40,462,400
日本エム・ディ・エム	7,700	980.00	7,546,000
ポプラ	2,900	253.00	733,700
フジ・コーポレーション	7,800	1,701.00	13,267,800
ユナイテッドアローズ	14,800	2,452.00	36,289,600
進和	8,400	2,178.00	18,295,200
エスケイジャパン	2,700	547.00	1,476,900
ダイترون	5,500	2,956.00	16,258,000
ハイデイ日高	20,600	2,438.00	50,222,800
シークス	19,800	1,495.00	29,601,000
YU-WA CREATION HOLDINGS	6,300	189.00	1,190,700
コロワイド	63,700	2,030.00	129,311,000
田中商事	3,200	646.00	2,067,200

オーハシテクニカ	6,700	1,549.00	10,378,300
壺番屋	10,900	5,340.00	58,206,000
白銅	5,100	2,278.00	11,617,800
トップカルチャー	3,600	194.00	698,400
P L A N T	2,600	724.00	1,882,400
スギホールディングス	27,900	6,294.00	175,602,600
ダイコー通産	1,200	1,085.00	1,302,000
薬王堂ホールディングス	7,700	2,558.00	19,696,600
島津製作所	159,300	4,358.00	694,229,400
J M S	12,200	565.00	6,893,000
クボテック	2,500	374.00	935,000
長野計器	9,500	2,153.00	20,453,500
ブイ・テクノロジー	6,300	2,404.00	15,145,200
スター精密	24,900	1,771.00	44,097,900
東京計器	10,000	1,302.00	13,020,000
愛知時計電機	5,200	1,542.00	8,018,400
インターアクション	6,100	1,442.00	8,796,200
オーバル	8,900	396.00	3,524,400
東京精密	28,800	7,760.00	223,488,000
マニー	52,300	1,646.00	86,085,800
ニコン	189,200	1,829.00	346,046,800
トプコン	68,900	1,990.00	137,111,000
オリンパス	805,800	2,209.50	1,780,415,100
理研計器	8,100	5,500.00	44,550,000
S C R E E Nホールディングス	22,400	15,795.00	353,808,000
キヤノン電子	14,500	1,906.00	27,637,000
タムロン	9,800	3,935.00	38,563,000
HOYA	277,300	16,165.00	4,482,554,500
シード	5,300	578.00	3,063,400
ノーリツ鋼機	12,500	2,291.00	28,637,500
A&Dホロンホールディングス	19,100	1,803.00	34,437,300
朝日インテック	146,200	2,720.00	397,664,000
キヤノン	718,300	3,733.00	2,681,413,900
リコー	328,300	1,203.00	394,944,900
シチズン時計	144,000	876.00	126,144,000
リズム	3,300	1,544.00	5,095,200
大研医器	7,500	510.00	3,825,000
メニコン	44,900	2,427.00	108,972,300
シンシア	1,000	576.00	576,000
KYORITSU	15,100	175.00	2,642,500
中本パックス	3,200	1,658.00	5,305,600
スノーピーク	22,400	1,823.00	40,835,200
パラマウントベッドホールディングス	30,200	2,280.00	68,856,000
トランザクション	8,500	1,889.00	16,056,500
粧美堂	2,900	406.00	1,177,400
ニホンフラッシュ	12,300	946.00	11,635,800
前田工織	11,000	3,050.00	33,550,000
永大産業	10,800	217.00	2,343,600
アートネイチャー	13,500	764.00	10,314,000
バンダイナムコホールディングス	358,600	3,113.00	1,116,321,800



アイフィスジャパン	3,000	618.00	1,854,000
SHOEI	29,600	2,556.00	75,657,600
フランスベッドホールディングス	15,100	1,134.00	17,123,400
マーベラス	21,300	670.00	14,271,000
パイロットコーポレーション	20,500	4,553.00	93,336,500
萩原工業	8,600	1,485.00	12,771,000
エイベックス	22,300	1,585.00	35,345,500
フジシールインターナショナル	26,500	1,518.00	40,227,000
タカラトミー	60,600	1,734.00	105,080,400
広済堂ホールディングス	6,800	2,315.00	15,742,000
エステールホールディングス	2,500	625.00	1,562,500
レック	18,700	826.00	15,446,200
タカノ	3,900	817.00	3,186,300
三光合成	16,500	648.00	10,692,000
プロネクサス	10,800	1,005.00	10,854,000
ホクシン	7,600	144.00	1,094,400
ウッドワン	3,500	1,214.00	4,249,000
大建工業	7,900	2,285.00	18,051,500
きもと	15,000	196.00	2,940,000
凸版印刷	160,900	3,049.00	490,584,100
大日本印刷	143,200	3,949.00	565,496,800
共同印刷	3,700	3,105.00	11,488,500
NISSHA	24,900	1,689.00	42,056,100
光村印刷	600	1,212.00	727,200
藤森工業	10,400	3,540.00	36,816,000
ヴィア・ホールディングス	16,000	84.00	1,344,000
TAKARA & COMPANY	8,300	2,258.00	18,741,400
前澤化成工業	8,300	1,505.00	12,491,500
未来工業	4,800	2,702.00	12,969,600
アシックス	120,800	4,219.00	509,655,200
ツツミ	2,400	2,298.00	5,515,200
ウェーブロックホールディングス	3,100	605.00	1,875,500
JSP	9,200	1,872.00	17,222,400
ニチハ	16,500	3,105.00	51,232,500
ローランド	9,600	4,125.00	39,600,000
エフピコ	24,800	2,863.50	71,014,800
小松ウオール工業	4,800	2,665.00	12,792,000
ヤマハ	82,500	5,268.00	434,610,000
河合楽器製作所	3,600	3,535.00	12,726,000
クリナップ	14,700	724.00	10,642,800
ピジョン	83,400	2,028.50	169,176,900
天馬	11,100	2,571.00	28,538,100
キングジム	11,600	876.00	10,161,600
象印マホービン	39,200	2,142.00	83,966,400
リンテック	26,300	2,263.00	59,516,900
信越ポリマー	24,200	1,455.00	35,211,000
東リ	22,900	342.00	7,831,800
イトーキ	26,900	1,074.00	28,890,600
任天堂	826,400	6,257.00	5,170,784,800
三菱鉛筆	18,600	1,665.00	30,969,000

松風	5,900	2,244.00	13,239,600
タカラスタンダード	24,100	1,889.00	45,524,900
コクヨ	63,000	1,990.50	125,401,500
ナカバヤシ	14,200	515.00	7,313,000
ニフコ	47,400	3,970.00	188,178,000
立川ブラインド工業	6,000	1,235.00	7,410,000
グロープライド	10,600	2,210.00	23,426,000
オカムラ	39,400	1,934.00	76,199,600
バルカー	10,900	3,785.00	41,256,500
MUTOHホールディングス	1,400	1,765.00	2,471,000
伊藤忠商事	853,400	5,508.00	4,700,527,200
丸紅	1,080,900	2,372.50	2,564,435,250
スクロール	20,600	928.00	19,116,800
高島	1,700	3,440.00	5,848,000
ヨンドシーホールディングス	11,900	1,885.00	22,431,500
三陽商会	4,000	2,042.00	8,168,000
長瀬産業	63,500	2,363.00	150,050,500
ナイガイ	3,600	291.00	1,047,600
蝶理	7,300	3,025.00	22,082,500
豊田通商	121,300	7,214.00	875,058,200
オンワードホールディングス	85,000	547.00	46,495,000
三共生興	20,000	587.00	11,740,000
兼松	53,700	2,012.00	108,044,400
美津濃	13,100	3,745.00	49,059,500
ツカモトコーポレーション	1,600	1,326.00	2,121,600
ルックホールディングス	3,000	2,525.00	7,575,000
三井物産	983,100	5,182.00	5,094,424,200
日本紙パルプ商事	7,300	4,615.00	33,689,500
東京エレクトロン	277,000	20,115.00	5,571,855,000
カメイ	14,700	1,470.00	21,609,000
東都水産	600	6,420.00	3,852,000
OUGホールディングス	1,600	2,437.00	3,899,200
スターゼン	10,600	2,290.00	24,274,000
セイコーグループ	20,300	2,590.00	52,577,000
山善	37,300	1,098.00	40,955,400
椿本興業	2,200	4,115.00	9,053,000
住友商事	857,700	2,965.00	2,543,080,500
BIPROGY	48,400	3,377.00	163,446,800
内田洋行	5,700	5,650.00	32,205,000
三菱商事	844,500	6,882.00	5,811,849,000
第一実業	4,900	5,160.00	25,284,000
キャノンマーケティングジャパン	32,100	3,555.00	114,115,500
西華産業	5,500	1,997.00	10,983,500
佐藤商事	9,600	1,440.00	13,824,000
菱洋エレクトロ	11,800	3,630.00	42,834,000
東京産業	12,700	875.00	11,112,500
ユアサ商事	11,900	4,455.00	53,014,500
神鋼商事	3,600	5,730.00	20,628,000
トルク	5,800	256.00	1,484,800
阪和興業	24,900	4,510.00	112,299,000

正栄食品工業	9,100	4,230.00	38,493,000
カナデン	9,200	1,301.00	11,969,200
RYODEN	11,100	2,219.00	24,630,900
ニプロ	109,200	1,016.00	110,947,200
岩谷産業	31,600	7,343.00	232,038,800
ナイス	3,000	1,458.00	4,374,000
ニチモウ	1,300	3,985.00	5,180,500
極東貿易	8,200	1,722.00	14,120,400
アステナホールディングス	23,900	450.00	10,755,000
三愛オブリ	36,600	1,494.00	54,680,400
稲畑産業	28,000	3,145.00	88,060,000
G S I クレオス	8,000	1,965.00	15,720,000
明和産業	18,400	671.00	12,346,400
クワザワホールディングス	3,600	534.00	1,922,400
キムラタン	60,300	20.00	1,206,000
ゴールドウイン	23,200	11,840.00	274,688,000
ユニ・チャーム	273,400	5,403.00	1,477,180,200
デザート	22,600	4,090.00	92,434,000
キング	4,600	616.00	2,833,600
ワキタ	25,400	1,235.00	31,369,000
ヤマトインターナショナル	8,000	301.00	2,408,000
東邦ホールディングス	34,500	2,665.00	91,942,500
サンゲツ	34,600	2,461.00	85,150,600
ミツウロコグループホールディングス	17,700	1,311.00	23,204,700
シナネンホールディングス	4,600	3,750.00	17,250,000
伊藤忠エネクス	34,400	1,267.00	43,584,800
サンリオ	39,200	6,067.00	237,826,400
サンワテクノス	7,000	2,315.00	16,205,000
リョーサン	14,700	4,320.00	63,504,000
新光商事	18,600	1,158.00	21,538,800
トーヨー	5,900	2,778.00	16,390,200
三信電気	5,700	2,124.00	12,106,800
東陽テクニカ	14,100	1,389.00	19,584,900
モスフードサービス	20,400	3,220.00	65,688,000
加賀電子	11,200	6,280.00	70,336,000
三益半導体工業	10,400	3,065.00	31,876,000
都築電気	6,900	1,877.00	12,951,300
ソーダニッカ	7,800	821.00	6,403,800
立花エレテック	10,100	2,770.00	27,977,000
木曽路	20,900	2,429.00	50,766,100
S R S ホールディングス	22,800	969.00	22,093,200
千趣会	25,400	392.00	9,956,800
タカキュー	7,500	88.00	660,000
リテールパートナーズ	20,600	1,552.00	31,971,200
ケーヨー	22,400	842.00	18,860,800
上新電機	12,400	1,993.00	24,713,200
日本瓦斯	73,400	1,926.00	141,368,400
ロイヤルホールディングス	26,900	2,622.00	70,531,800
東天紅	600	776.00	465,600
いなげや	13,500	1,478.00	19,953,000

チヨダ	13,200	893.00	11,787,600
ライフコーポレーション	12,100	3,270.00	39,567,000
リンガーハット	17,800	2,502.00	44,535,600
MrMaxHD	19,400	625.00	12,125,000
テンアライド	12,000	289.00	3,468,000
AOKIホールディングス	25,700	911.00	23,412,700
オークワ	22,200	839.00	18,625,800
コメリ	21,300	2,865.00	61,024,500
青山商事	29,600	1,270.00	37,592,000
しまむら	16,300	13,410.00	218,583,000
はせがわ	5,100	374.00	1,907,400
高島屋	104,400	1,974.50	206,137,800
松屋	23,500	1,219.00	28,646,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,400	1,494.00	100,695,600
近鉄百貨店	5,900	2,491.00	14,696,900
丸井グループ	102,100	2,457.50	250,910,750
クレディセゾン	81,700	2,230.00	182,191,000
アクシアル リテイリング	9,400	3,595.00	33,793,000
井筒屋	5,100	339.00	1,728,900
イオン	469,500	3,004.00	1,410,378,000
イズミ	21,000	3,345.00	70,245,000
フォーバル	5,300	1,095.00	5,803,500
平和堂	23,100	2,342.00	54,100,200
フジ	21,200	1,767.00	37,460,400
ヤオコー	15,600	7,325.00	114,270,000
ゼビオホールディングス	18,700	1,093.00	20,439,100
ケーズホールディングス	98,000	1,259.00	123,382,000
PALTAC	21,800	4,722.00	102,939,600
三谷産業	24,200	318.00	7,695,600
Olympicグループ	4,100	550.00	2,255,000
日産東京販売ホールディングス	13,800	378.00	5,216,400
あおぞら銀行	81,100	2,707.00	219,537,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,074,600	1,052.00	8,494,479,200
りそなホールディングス	1,629,600	709.50	1,156,201,200
三井住友トラスト・ホールディングス	234,200	5,183.00	1,213,858,600
三井住友フィナンシャルグループ	942,200	6,081.00	5,729,518,200
千葉銀行	359,300	907.00	325,885,100
群馬銀行	250,300	538.50	134,786,550
武蔵野銀行	16,600	2,327.00	38,628,200
千葉興業銀行	23,400	653.00	15,280,200
筑波銀行	56,500	205.00	11,582,500
七十七銀行	41,300	2,681.00	110,725,300
秋田銀行	8,500	1,690.00	14,365,000
山形銀行	14,300	1,053.00	15,057,900
岩手銀行	8,700	2,123.00	18,470,100
東邦銀行	101,800	234.00	23,821,200
東北銀行	4,900	1,027.00	5,032,300
ふくおかフィナンシャルグループ	103,000	3,100.00	319,300,000
スルガ銀行	113,600	571.00	64,865,600
八十二銀行	272,300	654.40	178,193,120

山梨中央銀行	13,200	1,300.00	17,160,000
大垣共立銀行	24,500	1,852.00	45,374,000
福井銀行	11,500	1,451.00	16,686,500
清水銀行	5,200	1,453.00	7,555,600
富山銀行	1,500	1,673.00	2,509,500
滋賀銀行	21,400	2,771.00	59,299,400
南都銀行	19,400	2,435.00	47,239,000
百五銀行	121,400	436.00	52,930,400
京都銀行	40,800	7,340.00	299,472,000
紀陽銀行	46,200	1,462.00	67,544,400
ほくほくフィナンシャルグループ	81,900	1,184.50	97,010,550
山陰合同銀行	80,700	855.00	68,998,500
鳥取銀行	3,300	1,170.00	3,861,000
百十四銀行	11,800	1,924.00	22,703,200
四国銀行	20,500	881.00	18,060,500
阿波銀行	18,000	2,009.00	36,162,000
大分銀行	7,700	2,245.00	17,286,500
宮崎銀行	8,300	2,400.00	19,920,000
佐賀銀行	7,500	1,708.00	12,810,000
琉球銀行	29,600	960.00	28,416,000
セブン銀行	461,900	288.40	133,211,960
みずほフィナンシャルグループ	1,864,700	2,213.50	4,127,513,450
高知銀行	3,500	750.00	2,625,000
山口フィナンシャルグループ	142,400	1,016.00	144,678,400
芙蓉総合リース	11,900	10,990.00	130,781,000
みずほリース	19,200	4,635.00	88,992,000
東京センチュリー	24,000	5,088.00	122,112,000
SBIホールディングス	186,700	2,831.50	528,641,050
日本証券金融	47,400	1,083.00	51,334,200
アイフル	213,600	335.00	71,556,000
日本アジア投資	7,900	240.00	1,896,000
名古屋銀行	8,400	3,475.00	29,190,000
北洋銀行	195,400	288.00	56,275,200
大光銀行	3,100	1,095.00	3,394,500
愛媛銀行	17,400	827.00	14,389,800
トマト銀行	3,400	1,047.00	3,559,800
京葉銀行	59,000	554.00	32,686,000
栃木銀行	59,100	261.00	15,425,100
北日本銀行	4,600	2,050.00	9,430,000
東和銀行	23,700	545.00	12,916,500
福島銀行	10,400	216.00	2,246,400
大東銀行	4,000	649.00	2,596,000
リコーリース	12,300	4,230.00	52,029,000
イオンフィナンシャルサービス	74,100	1,272.00	94,255,200
アコム	230,000	346.90	79,787,000
ジャックス	13,800	5,050.00	69,690,000
オリエントコーポレーション	33,700	1,156.00	38,957,200
オリックス	846,300	2,539.00	2,148,755,700
三菱HCキャピタル	502,700	861.70	433,176,590
ジャフコグループ	43,000	1,777.50	76,432,500

九州リースサービス	4,800	864.00	4,147,200
トモニホールディングス	104,100	376.00	39,141,600
大和証券グループ本社	921,800	715.00	659,087,000
野村ホールディングス	2,374,400	538.30	1,278,139,520
岡三証券グループ	113,200	482.00	54,562,400
丸三証券	42,900	439.00	18,833,100
東洋証券	42,800	301.00	12,882,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	140,400	394.00	55,317,600
光世証券	2,400	586.00	1,406,400
水戸証券	34,600	345.00	11,937,000
いちよし証券	23,800	610.00	14,518,000
松井証券	76,200	796.00	60,655,200
SOMPOホールディングス	221,300	6,569.00	1,453,719,700
日本取引所グループ	362,400	2,337.00	846,928,800
マネックスグループ	138,900	541.00	75,144,900
極東証券	16,100	648.00	10,432,800
岩井コスモホールディングス	14,700	1,474.00	21,667,800
アイザワ証券グループ	18,600	799.00	14,861,400
フィデアホールディングス	13,300	1,408.00	18,726,400
池田泉州ホールディングス	165,100	243.00	40,119,300
アニコムホールディングス	43,800	628.00	27,506,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	262,400	5,136.00	1,347,686,400
マネーパートナーズグループ	10,500	264.00	2,772,000
スパークス・グループ	14,400	1,475.00	21,240,000
小林洋行	2,800	239.00	669,200
第一生命ホールディングス	630,000	2,824.50	1,779,435,000
東京海上ホールディングス	1,274,400	3,249.00	4,140,525,600
アドバンテッジリスクマネジメント	4,800	581.00	2,788,800
イー・ギャランティ	20,900	1,921.00	40,148,900
アサックス	4,700	643.00	3,022,100
NECキャピタルソリューション	6,300	3,095.00	19,498,500
T&Dホールディングス	346,000	2,167.50	749,955,000
アドバンスクリエイト	7,400	1,224.00	9,057,600
三井不動産	550,300	2,809.00	1,545,792,700
三菱地所	778,000	1,713.50	1,333,103,000
平和不動産	20,900	3,775.00	78,897,500
東京建物	122,800	1,872.00	229,881,600
京阪神ビルディング	21,700	1,151.00	24,976,700
住友不動産	233,100	3,572.00	832,633,200
太平洋興発	3,800	766.00	2,910,800
テーオーシー	23,300	620.00	14,446,000
東京楽天地	2,200	4,160.00	9,152,000
レオパレス21	145,100	302.00	43,820,200
スターツコーポレーション	18,500	2,826.00	52,281,000
フジ住宅	18,000	679.00	12,222,000
空港施設	15,600	558.00	8,704,800
明和地所	4,800	1,066.00	5,116,800
ゴールドクレスト	12,300	1,857.00	22,841,100

リログループ	74,900	1,920.50	143,845,450
エスリード	6,000	2,635.00	15,810,000
日神グループホールディングス	20,700	502.00	10,391,400
日本エスコン	29,000	814.00	23,606,000
MIRARTHホールディングス	65,100	450.00	29,295,000
AVANTIA	5,700	882.00	5,027,400
イオンモール	66,800	1,884.00	125,851,200
毎日コムネット	3,800	735.00	2,793,000
ファースト住建	4,100	1,101.00	4,514,100
ランド	776,100	9.00	6,984,900
カチタス	34,600	2,575.00	89,095,000
東祥	9,300	1,325.00	12,322,500
トーセイ	21,400	1,790.00	38,306,000
穴吹興産	2,000	2,185.00	4,370,000
サンフロンティア不動産	21,500	1,426.00	30,659,000
FJネクストホールディングス	13,600	1,025.00	13,940,000
インテリックス	2,500	521.00	1,302,500
ランドビジネス	3,800	261.00	991,800
サンネクスタグループ	3,100	955.00	2,960,500
グランディハウス	8,300	580.00	4,814,000
東武鉄道	143,900	3,684.00	530,127,600
相鉄ホールディングス	43,200	2,479.00	107,092,800
東急	367,200	1,695.50	622,587,600
京浜急行電鉄	148,500	1,297.50	192,678,750
小田急電鉄	198,500	1,886.50	374,470,250
京王電鉄	69,300	4,331.00	300,138,300
京成電鉄	84,400	5,874.00	495,765,600
富士急行	16,100	5,380.00	86,618,000
東日本旅客鉄道	222,100	7,889.00	1,752,146,900
西日本旅客鉄道	167,300	5,835.00	976,195,500
東海旅客鉄道	100,800	17,500.00	1,764,000,000
西武ホールディングス	158,300	1,490.50	235,946,150
鴻池運輸	22,400	1,731.00	38,774,400
西日本鉄道	34,900	2,450.00	85,505,000
ハマキョウレックス	10,300	3,710.00	38,213,000
サカイ引越センター	6,200	5,070.00	31,434,000
近鉄グループホールディングス	130,700	4,703.00	614,682,100
阪急阪神ホールディングス	174,300	4,616.00	804,568,800
南海電気鉄道	62,400	3,063.00	191,131,200
京阪ホールディングス	72,100	3,683.00	265,544,300
神戸電鉄	3,600	2,970.00	10,692,000
名古屋鉄道	144,500	2,256.00	325,992,000
山陽電気鉄道	9,800	2,178.00	21,344,400
アルプス物流	10,500	1,560.00	16,380,000
トランコム	3,900	6,950.00	27,105,000
ヤマトホールディングス	167,400	2,606.50	436,328,100
山九	33,300	4,705.00	156,676,500
日新	9,900	2,502.00	24,769,800
丸運	5,300	242.00	1,282,600
丸全昭和運輸	8,100	3,975.00	32,197,500

センコーグループホールディングス	69,400	1,006.00	69,816,400
トナミホールディングス	2,400	4,795.00	11,508,000
ニッコンホールディングス	41,800	2,830.00	118,294,000
日本石油輸送	900	2,816.00	2,534,400
福山通運	9,900	3,920.00	38,808,000
セイノーホールディングス	81,300	2,136.00	173,656,800
エスライングループ本社	3,100	851.00	2,638,100
神奈川中央交通	3,800	3,130.00	11,894,000
AZ-COM丸和ホールディングス	31,600	2,020.00	63,832,000
C&Fロジホールディングス	12,700	1,250.00	15,875,000
日本郵船	349,700	3,267.00	1,142,469,900
商船三井	230,300	3,528.00	812,498,400
川崎汽船	98,300	3,769.00	370,492,700
NSユニテッド海運	6,900	3,495.00	24,115,500
明治海運	9,900	573.00	5,672,700
飯野海運	48,100	874.00	42,039,400
共栄タンカー	1,900	857.00	1,628,300
九州旅客鉄道	92,300	3,083.00	284,560,900
SGホールディングス	250,900	2,080.00	521,872,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	48,700	8,106.00	394,762,200
ID&Eホールディングス	8,400	3,210.00	26,964,000
日本航空	320,900	3,098.00	994,148,200
ANAホールディングス	355,500	3,356.00	1,193,058,000
ビーウィズ	3,500	2,229.00	7,801,500
パスコ	2,000	1,776.00	3,552,000
TREホールディングス	28,400	1,243.00	35,301,200
人・夢・技術グループ	5,100	1,693.00	8,634,300
西本Wismettacホールディングス	3,600	4,530.00	16,308,000
シルバーライフ	2,700	1,361.00	3,674,700
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	2,048.00	1,843,200
Genky Drug Stores	6,000	4,100.00	24,600,000
コア商事ホールディングス	7,700	648.00	4,989,600
KPPグループホールディングス	32,300	635.00	20,510,500
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	1,025.00	1,845,000
ブックオフグループホールディングス	6,900	1,194.00	8,238,600
ギフトホールディングス	3,000	4,555.00	13,665,000
三菱倉庫	28,100	3,436.00	96,551,600
三井倉庫ホールディングス	12,200	3,480.00	42,456,000
住友倉庫	35,200	2,379.00	83,740,800
澁澤倉庫	5,300	2,778.00	14,723,400
ヤマタネ	6,100	1,699.00	10,363,900
東陽倉庫	13,700	271.00	3,712,700
乾汽船	16,600	1,265.00	20,999,000
日本トランスシティ	26,400	626.00	16,526,400
ケイヒン	1,900	1,752.00	3,328,800
中央倉庫	6,300	1,087.00	6,848,100
川西倉庫	1,800	1,033.00	1,859,400
安田倉庫	9,000	994.00	8,946,000



ファイズホールディングス	1,900	1,178.00	2,238,200
大栄環境	34,300	2,383.00	81,736,900
日本管財ホールディングス	14,200	2,577.00	36,593,400
東洋埠頭	3,100	1,365.00	4,231,500
上組	62,700	3,206.00	201,016,200
サンリツ	2,400	740.00	1,776,000
キムラユニティー	4,900	1,255.00	6,149,500
キューソー流通システム	6,100	916.00	5,587,600
東海運	6,100	287.00	1,750,700
エーアイテイナー	8,200	1,804.00	14,792,800
内外トランスライン	4,800	2,551.00	12,244,800
ショーエイコーポレーション	3,100	601.00	1,863,100
日本コンセプト	4,200	1,962.00	8,240,400
TBSホールディングス	67,200	2,548.50	171,259,200
日本テレビホールディングス	116,300	1,317.00	153,167,100
朝日放送グループホールディングス	12,400	660.00	8,184,000
テレビ朝日ホールディングス	31,900	1,667.00	53,177,300
スカパーJ SATホールディングス	116,600	568.00	66,228,800
テレビ東京ホールディングス	9,400	3,365.00	31,631,000
日本BS放送	3,700	931.00	3,444,700
ビジョン	17,400	1,683.00	29,284,200
スマートバリュー	2,600	384.00	998,400
USEN-NEXT HOLDINGS	14,700	3,490.00	51,303,000
ワイヤレスゲート	4,500	228.00	1,026,000
日本通信	121,100	243.00	29,427,300
クロップス	1,700	1,009.00	1,715,300
日本電信電話	42,061,100	163.00	6,855,959,300
KDDI	1,014,600	4,242.00	4,303,933,200
ソフトバンク	2,109,300	1,523.00	3,212,463,900
光通信	15,500	20,385.00	315,967,500
エムティーアイ	8,900	559.00	4,975,100
GMOインターネットグループ	48,500	2,716.00	131,726,000
ファイバーゲート	6,900	1,390.00	9,591,000
アイドママーケティングコミュニケーション	2,500	276.00	690,000
KADOKAWA	69,500	3,354.00	233,103,000
学研ホールディングス	21,800	872.00	19,009,600
ゼンリン	22,500	927.00	20,857,500
昭文社ホールディングス	4,500	299.00	1,345,500
インプレスホールディングス	8,900	229.00	2,038,100
東京電力ホールディングス	1,180,100	513.60	606,099,360
中部電力	482,300	1,684.00	812,193,200
関西電力	505,500	1,716.50	867,690,750
中国電力	208,400	941.10	196,125,240
北陸電力	123,500	744.00	91,884,000
東北電力	319,900	874.30	279,688,570
四国電力	111,700	957.10	106,908,070
九州電力	301,700	896.50	270,474,050
北海道電力	126,500	561.90	71,080,350

沖縄電力	30,700	1,131.00	34,721,700
電源開発	98,600	2,142.00	211,201,200
エフオン	8,400	536.00	4,502,400
イーレックス	23,200	1,129.00	26,192,800
レノバ	34,700	1,488.00	51,633,600
東京瓦斯	276,800	3,088.00	854,758,400
大阪瓦斯	265,100	2,110.00	559,361,000
東邦瓦斯	51,600	2,401.00	123,891,600
北海道瓦斯	7,800	2,282.00	17,799,600
広島ガス	27,600	372.00	10,267,200
西部ガスホールディングス	12,300	1,982.00	24,378,600
静岡ガス	29,800	1,053.00	31,379,400
メタウォーター	15,600	1,820.00	28,392,000
アイネット	7,900	1,641.00	12,963,900
松竹	7,400	10,675.00	78,995,000
東宝	82,100	5,444.00	446,952,400
エイチ・アイ・エス	35,100	2,028.00	71,182,800
東映	3,600	17,700.00	63,720,000
ラックランド	5,700	3,145.00	17,926,500
NTTデータグループ	412,000	1,920.50	791,246,000
共立メンテナンス	23,000	5,465.00	125,695,000
イチネンホールディングス	14,300	1,336.00	19,104,800
建設技術研究所	6,900	3,335.00	23,011,500
スペース	9,700	1,034.00	10,029,800
アインホールディングス	19,100	5,044.00	96,340,400
燦ホールディングス	5,800	2,172.00	12,597,600
ピー・シー・エー	7,500	1,428.00	10,710,000
スバル興業	600	9,880.00	5,928,000
東京テアトル	3,900	1,121.00	4,371,900
タナベコンサルティンググループ	4,200	1,015.00	4,263,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,700	2,270.00	12,939,000
ナガワ	3,700	6,760.00	25,012,000
東京都競馬	11,200	3,775.00	42,280,000
常磐興産	3,700	1,230.00	4,551,000
カナモト	24,600	2,354.00	57,908,400
D T S	28,000	3,230.00	90,440,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	65,900	6,292.00	414,642,800
シーイーシー	18,400	1,768.00	32,531,200
カブコン	130,500	5,571.00	727,015,500
ニシオホールディングス	12,600	3,435.00	43,281,000
アイ・エス・ビー	6,700	1,558.00	10,438,600
アゴーラ ホスピタリティグループ	58,500	25.00	1,462,500
日本空港ビルデング	45,600	6,492.00	296,035,200
トランス・コスモス	16,800	3,355.00	56,364,000
乃村工藝社	58,700	953.00	55,941,100
ジャステック	8,000	1,344.00	10,752,000
S C S K	107,200	2,222.50	238,252,000
藤田観光	5,900	3,600.00	21,240,000

KNT-CTホールディングス	8,000	1,458.00	11,664,000
トーカイ	11,900	1,863.00	22,169,700
白洋舎	1,300	2,555.00	3,321,500
セコム	137,000	9,373.00	1,284,101,000
NSW	5,200	2,381.00	12,381,200
セントラル警備保障	7,200	2,915.00	20,988,000
アイネス	9,200	1,470.00	13,524,000
丹青社	26,100	787.00	20,540,700
メイテック	52,500	2,410.00	126,525,000
TKC	20,900	3,750.00	78,375,000
富士ソフト	29,700	4,540.00	134,838,000
応用地質	12,600	2,268.00	28,576,800
船井総研ホールディングス	28,000	2,445.00	68,460,000
NSD	46,900	2,751.00	129,021,900
進学会ホールディングス	3,600	290.00	1,044,000
丸紅建材リース	900	2,440.00	2,196,000
オオバ	6,500	752.00	4,888,000
コナミグループ	56,100	7,492.00	420,301,200
いであ	2,400	1,715.00	4,116,000
学究社	5,400	2,065.00	11,151,000
ベネッセホールディングス	50,300	1,841.00	92,602,300
イオンディライト	14,900	3,020.00	44,998,000
ナック	5,900	958.00	5,652,200
福井コンピュータホールディングス	9,000	2,660.00	23,940,000
ダイセキ	27,400	4,275.00	117,135,000
ステップ	4,900	1,757.00	8,609,300
泉州電業	6,900	3,650.00	25,185,000
元気寿司	4,000	3,395.00	13,580,000
トラスコ中山	29,100	2,187.00	63,641,700
ヤマダホールディングス	567,800	427.10	242,507,380
オートバックスセブン	48,300	1,546.50	74,695,950
モリト	9,900	1,079.00	10,682,100
アークランズ	20,200	1,558.00	31,471,600
ニトリホールディングス	56,000	16,460.00	921,760,000
グルメ杵屋	11,200	1,029.00	11,524,800
愛眼	8,100	185.00	1,498,500
ケーユーホールディングス	8,100	1,200.00	9,720,000
吉野家ホールディングス	54,100	2,601.50	140,741,150
加藤産業	17,200	3,815.00	65,618,000
北恵	2,500	789.00	1,972,500
イノテック	8,600	1,606.00	13,811,600
イエローハット	24,400	1,833.00	44,725,200
松屋フーズホールディングス	6,500	4,105.00	26,682,500
JBCホールディングス	9,500	2,457.00	23,341,500
JKホールディングス	10,700	985.00	10,539,500
サガミホールディングス	22,300	1,270.00	28,321,000
日伝	8,200	2,413.00	19,786,600
関西フードマーケット	12,600	1,438.00	18,118,800
ミロク情報サービス	11,900	1,581.00	18,813,900
北沢産業	5,800	350.00	2,030,000

杉本商事	6,100	2,089.00	12,742,900
因幡電機産業	35,900	3,120.00	112,008,000
王将フードサービス	9,000	6,570.00	59,130,000
ミニストップ	10,100	1,456.00	14,705,600
アークス	25,300	2,467.00	62,415,100
バローホールディングス	26,400	2,005.00	52,932,000
東テク	4,700	5,360.00	25,192,000
ミスミグループ本社	209,000	2,819.00	589,171,000
アルテック	5,900	254.00	1,498,600
ベルク	6,900	6,740.00	46,506,000
大 庄	5,800	1,125.00	6,525,000
タキヒヨー	2,700	1,197.00	3,231,900
ファーストリテイリング	62,300	34,630.00	2,157,449,000
ソフトバンクグループ	647,700	6,751.00	4,372,622,700
蔵王産業	1,800	2,336.00	4,204,800
スズケン	40,500	3,848.00	155,844,000
サンドラッグ	52,500	4,206.00	220,815,000
サックスパー ホールディングス	13,200	939.00	12,394,800
ジェコス	8,300	871.00	7,229,300
ヤマザワ	2,000	1,268.00	2,536,000
やまや	2,300	2,682.00	6,168,600
グローセル	13,000	413.00	5,369,000
ベルーナ	33,400	699.00	23,346,600
合計	195,436,600		418,269,121,420

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

One グローバルバランス	40,070,255円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型	746,657,608円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	2,391,956,199円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型	2,684,302,273円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	423,631,209円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	779,070,256円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,420,160円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	895,628,565円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	35,241,998円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	159,329,380円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	154,850,470円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	248,203,562円
クルーズコントロール	1,346,975,128円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	675,693,591円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	646,072,045円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,400,956円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	371,894,929円
One グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	8,579,675円
One グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	78,149,920円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	1,031,313,518円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	97,508,740円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	99,918,494円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	127,490,675円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	60,517,247円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	95,603,282円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	206,325,819円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	417,486,928円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	86,516,318円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	427,801,018円
D I A M 為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,915,002,883円
D I A M 外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,397,314,344円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,058,371,359円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,278,146,097円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	124,533,142円
D I A M ワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	47,507,942円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	161,981,893円
D I A M グローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	345,527,019円
D I A M グローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限	235,871,672円

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等



を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

### (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

種類	2023年7月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	△2,660,810,010	
合計	△2,660,810,010	

(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22日から2023年7月11日まで)に対応する金額であります。

### (デリバティブ取引等に関する注記)

#### 通貨関連

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

ユーロ	297,189,000	—	296,084,158	△1,104,842
合計	2,498,699,000	—	2,493,702,711	△4,923,831

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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7月11日現在
1口当たり純資産額	2.1425円
(1万口当たり純資産額)	(21,425円)

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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/31/25	1,690,000.000	1,548,660.550	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,199,355.460	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,460,968.750	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,260,168.750	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,370,814.050	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,612,343.760	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,116,863.250	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,358,700.000	
		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,804,093.310	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,223,631.250	
		US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,884,589.850	
		US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,888,203.120	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,231,653.880	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,686,205.080	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,605,781.240	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,643,104.290	
US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,649,075.000			

US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,048,661.320	
US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,569,784.370	
US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,390,202.740	
US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,617,136.720	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,113,287.500	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,916,234.350	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,480,163.080	
US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,538,203.110	
US T N/B 0.625 08/15/30	8,240,000.000	6,492,701.550	
US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,775,000.000	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,327,644.530	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,820,000.000	3,252,073.410	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,742,162.500	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,166,992.160	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,400,000.000	3,059,734.380	
US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,052,705.080	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,409,173.830	
US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,458,905.470	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	2,979,387.890	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,910,000.000	4,387,353.520	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,280,000.000	6,626,102.350	
US T N/B 1.0 07/31/28	4,770,000.000	4,068,101.940	
US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,347,085.930	
US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,596,540.610	
US T N/B 1.125 02/15/31	8,890,000.000	7,228,507.610	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,797,009.370	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	979,257.810	
US T N/B 1.125 02/29/28	6,390,000.000	5,544,323.430	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,076,744.130	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,160,000.000	2,597,724.970	
US T N/B 1.125 08/31/28	5,230,000.000	4,480,230.440	
US T N/B 1.125 10/31/26	5,190,000.000	4,660,255.080	
US T N/B 1.25 03/31/28	5,010,000.000	4,365,158.180	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,434,011.700	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,880,000.000	2,639,203.100	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,592,743.750	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,212,773.030	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,660,000.000	7,011,048.000	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,741,298.430	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,480,000.000	3,855,600.000	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,227,613.290	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,494,314.050	
US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	708,281.250	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,721,873.420	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,100,000.000	1,907,964.840	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,072,862.090	
US T N/B 1.375 11/15/31	8,790,000.000	7,146,338.630	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,020,000.000	2,613,549.610	
US T N/B 1.375 12/31/28	5,900,000.000	5,084,371.070	
US T N/B 1.5 01/31/27	4,940,000.000	4,464,717.940	

US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,300,994.150	
US T N/B 1.5 02/15/30	5,130,000.000	4,351,582.600	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,405,810.550	
US T N/B 1.5 09/30/24	4,310,000.000	4,117,733.570	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,629,870.300	
US T N/B 1.5 11/30/24	9,000,000.000	8,556,328.080	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,345,507.800	
US T N/B 1.625 02/15/26	3,890,000.000	3,603,568.360	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,382,707.800	
US T N/B 1.625 05/15/31	8,240,000.000	6,913,392.200	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,424,471.840	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,417,523.430	
US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,561,343.550	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	2,857,730.440	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,649,362.500	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	3,949,453.120	
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,788,906.240	
US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,916,172.590	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,110,000.000	3,493,263.860	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,781,898.430	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,894,464.450	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,928,671.870	
US T N/B 1.875 02/15/32	8,280,000.000	6,989,160.910	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,700,000.000	3,320,201.150	
US T N/B 1.875 02/15/51	6,280,000.000	4,007,179.690	
US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,301,457.800	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,531,718.750	
US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,742,892.170	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,849,687.500	
US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	788,801.550	
US T N/B 1.875 11/15/51	4,670,000.000	2,969,280.830	
US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,943,657.810	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,457,960.920	
US T N/B 2.0 08/15/25	4,050,000.000	3,823,769.510	
US T N/B 2.0 08/15/51	6,110,000.000	4,013,506.250	
US T N/B 2.0 11/15/26	3,830,000.000	3,536,466.420	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,028,540.040	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,754,197.270	
US T N/B 2.125 05/31/26	1,550,000.000	1,448,160.160	
US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	367,357.040	
US T N/B 2.125 09/30/24	590,000.000	567,944.140	
US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,706,853.120	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,505,950.000	
US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	2,996,058.570	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,102,902.340	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,310,856.240	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,907,093.760	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,570,000.000	1,816,166.780	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,131,206.240	
US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,261,324.200	

US T N/B 2. 25 11/15/24	3,080,000.000	2,961,732.800
US T N/B 2. 25 11/15/25	5,120,000.000	4,837,799.960
US T N/B 2. 25 11/15/27	3,270,000.000	3,000,608.210
US T N/B 2. 25 12/31/24	3,000,000.000	2,876,718.750
US T N/B 2. 375 02/15/42	3,610,000.000	2,735,068.550
US T N/B 2. 375 03/31/29	3,500,000.000	3,171,738.290
US T N/B 2. 375 04/30/26	1,260,000.000	1,187,107.030
US T N/B 2. 375 05/15/27	4,430,000.000	4,113,151.150
US T N/B 2. 375 05/15/29	3,470,000.000	3,140,485.510
US T N/B 2. 375 05/15/51	5,560,000.000	3,989,734.330
US T N/B 2. 375 08/15/24	4,610,000.000	4,464,857.000
US T N/B 2. 375 11/15/49	3,290,000.000	2,370,213.670
US T N/B 2. 5 01/31/25	500,000.000	480,507.810
US T N/B 2. 5 02/15/45	2,310,000.000	1,733,943.750
US T N/B 2. 5 02/15/46	1,770,000.000	1,319,479.680
US T N/B 2. 5 02/28/26	2,280,000.000	2,159,943.730
US T N/B 2. 5 03/31/27	1,500,000.000	1,402,148.430
US T N/B 2. 5 05/15/46	2,230,000.000	1,660,566.020
US T N/B 2. 625 01/31/26	2,460,000.000	2,340,363.280
US T N/B 2. 625 02/15/29	4,330,000.000	3,983,515.420
US T N/B 2. 625 03/31/25	1,790,000.000	1,719,658.570
US T N/B 2. 625 04/15/25	3,000,000.000	2,879,765.640
US T N/B 2. 625 05/31/27	3,410,000.000	3,194,210.930
US T N/B 2. 625 07/31/29	2,570,000.000	2,354,160.140
US T N/B 2. 625 12/31/25	3,000,000.000	2,856,210.930
US T N/B 2. 75 02/15/28	4,540,000.000	4,247,382.830
US T N/B 2. 75 02/28/25	1,960,000.000	1,890,213.260
US T N/B 2. 75 04/30/27	3,500,000.000	3,297,109.370
US T N/B 2. 75 05/15/25	4,000,000.000	3,844,375.000
US T N/B 2. 75 05/31/29	3,300,000.000	3,048,375.000
US T N/B 2. 75 06/30/25	1,040,000.000	998,400.000
US T N/B 2. 75 07/31/27	3,820,000.000	3,589,606.250
US T N/B 2. 75 08/15/32	7,840,000.000	7,079,121.880
US T N/B 2. 75 08/15/42	540,000.000	433,350.000
US T N/B 2. 75 08/15/47	2,230,000.000	1,732,997.450
US T N/B 2. 75 08/31/25	1,830,000.000	1,753,654.680
US T N/B 2. 75 11/15/42	1,556,000.000	1,246,137.190
US T N/B 2. 75 11/15/47	2,250,000.000	1,748,891.600
US T N/B 2. 875 04/30/25	2,000,000.000	1,927,265.620
US T N/B 2. 875 04/30/29	3,000,000.000	2,792,343.740
US T N/B 2. 875 05/15/28	4,860,000.000	4,562,325.000
US T N/B 2. 875 05/15/32	8,050,000.000	7,356,788.080
US T N/B 2. 875 05/15/43	2,290,000.000	1,863,040.220
US T N/B 2. 875 05/15/49	4,300,000.000	3,435,464.820
US T N/B 2. 875 05/15/52	4,510,000.000	3,606,590.620
US T N/B 2. 875 05/31/25	1,570,000.000	1,511,983.600
US T N/B 2. 875 06/15/25	3,420,000.000	3,291,616.410
US T N/B 2. 875 07/31/25	2,200,000.000	2,116,210.930
US T N/B 2. 875 08/15/28	4,530,000.000	4,243,512.870
US T N/B 2. 875 08/15/45	1,770,000.000	1,417,037.110

US T N/B 2. 875 11/15/46	1, 080, 000. 000	861, 932. 800	
US T N/B 2. 875 11/30/25	3, 360, 000. 000	3, 219, 956. 240	
US T N/B 3. 0 02/15/47	2, 660, 000. 000	2, 168, 003. 880	
US T N/B 3. 0 02/15/48	2, 650, 000. 000	2, 160, 060. 530	
US T N/B 3. 0 02/15/49	3, 110, 000. 000	2, 543, 153. 910	
US T N/B 3. 0 05/15/42	1, 080, 000. 000	904, 500. 000	
US T N/B 3. 0 05/15/45	2, 290, 000. 000	1, 876, 994. 920	
US T N/B 3. 0 05/15/47	1, 620, 000. 000	1, 319, 540. 620	
US T N/B 3. 0 07/15/25	3, 200, 000. 000	3, 085, 124. 990	
US T N/B 3. 0 07/31/24	3, 820, 000. 000	3, 726, 480. 550	
US T N/B 3. 0 08/15/48	3, 810, 000. 000	3, 107, 084. 740	
US T N/B 3. 0 08/15/52	3, 740, 000. 000	3, 067, 530. 450	
US T N/B 3. 0 09/30/25	1, 750, 000. 000	1, 684, 716. 780	
US T N/B 3. 0 10/31/25	2, 270, 000. 000	2, 183, 101. 560	
US T N/B 3. 0 11/15/44	1, 560, 000. 000	1, 281, 576. 550	
US T N/B 3. 0 11/15/45	860, 000. 000	703, 050. 000	
US T N/B 3. 125 02/15/42	1, 360, 000. 000	1, 165, 084. 370	
US T N/B 3. 125 02/15/43	1, 740, 000. 000	1, 476, 349. 200	
US T N/B 3. 125 05/15/48	2, 830, 000. 000	2, 360, 949. 580	
US T N/B 3. 125 08/15/25	3, 030, 000. 000	2, 927, 382. 410	
US T N/B 3. 125 08/15/44	2, 090, 000. 000	1, 756, 253. 120	
US T N/B 3. 125 08/31/27	3, 940, 000. 000	3, 755, 620. 280	
US T N/B 3. 125 08/31/29	3, 110, 000. 000	2, 928, 623. 830	
US T N/B 3. 125 11/15/28	4, 380, 000. 000	4, 146, 628. 110	
US T N/B 3. 125 11/15/41	1, 020, 000. 000	876, 283. 580	
US T N/B 3. 25 05/15/42	3, 760, 000. 000	3, 268, 115. 620	
US T N/B 3. 25 06/30/27	3, 500, 000. 000	3, 355, 351. 580	
US T N/B 3. 25 06/30/29	3, 000, 000. 000	2, 846, 835. 930	
US T N/B 3. 375 05/15/33	1, 500, 000. 000	1, 423, 476. 570	
US T N/B 3. 375 05/15/44	1, 430, 000. 000	1, 252, 367. 170	
US T N/B 3. 375 08/15/42	2, 920, 000. 000	2, 580, 435. 940	
US T N/B 3. 375 11/15/48	3, 450, 000. 000	3, 014, 976. 550	
US T N/B 3. 5 01/31/28	3, 380, 000. 000	3, 267, 641. 390	
US T N/B 3. 5 01/31/30	2, 500, 000. 000	2, 403, 027. 350	
US T N/B 3. 5 02/15/33	5, 000, 000. 000	4, 793, 750. 000	
US T N/B 3. 5 02/15/39	500, 000. 000	468, 203. 120	
US T N/B 3. 5 04/30/30	2, 000, 000. 000	1, 922, 500. 000	
US T N/B 3. 5 09/15/25	3, 000, 000. 000	2, 919, 023. 430	
US T N/B 3. 625 02/15/44	1, 630, 000. 000	1, 484, 446. 080	
US T N/B 3. 625 02/15/53	3, 200, 000. 000	2, 966, 249. 980	
US T N/B 3. 625 03/31/30	2, 000, 000. 000	1, 936, 914. 060	
US T N/B 3. 625 05/15/26	3, 500, 000. 000	3, 410, 449. 210	
US T N/B 3. 625 05/15/53	2, 010, 000. 000	1, 865, 217. 180	
US T N/B 3. 625 08/15/43	1, 470, 000. 000	1, 340, 973. 020	
US T N/B 3. 75 04/15/26	6, 000, 000. 000	5, 865, 468. 720	
US T N/B 3. 75 08/15/41	820, 000. 000	772, 850. 000	
US T N/B 3. 75 11/15/43	1, 460, 000. 000	1, 355, 518. 750	
US T N/B 3. 875 01/15/26	5, 800, 000. 000	5, 687, 398. 450	
US T N/B 3. 875 02/15/43	2, 500, 000. 000	2, 374, 609. 370	
US T N/B 3. 875 03/31/25	1, 050, 000. 000	1, 030, 148. 430	

	US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,248,830.840	
	US T N/B 3.875 09/30/29	2,250,000.000	2,208,515.620	
	US T N/B 3.875 11/30/27	3,000,000.000	2,945,507.820	
	US T N/B 3.875 11/30/29	2,300,000.000	2,259,031.250	
	US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,516,445.320	
	US T N/B 3.875 12/31/29	2,000,000.000	1,964,296.880	
	US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,935,156.240	
	US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,969,062.500	
	US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,161,750.010	
	US T N/B 4.0 10/31/29	2,500,000.000	2,471,679.700	
	US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	3,018,112.490	
	US T N/B 4.0 11/15/52	4,860,000.000	4,823,170.320	
	US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,072,239.830	
	US T N/B 4.125 01/31/25	1,800,000.000	1,773,281.250	
	US T N/B 4.125 09/30/27	3,920,000.000	3,884,015.610	
	US T N/B 4.125 10/31/27	2,340,000.000	2,319,067.970	
	US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,651,062.480	
	US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	970,595.690	
	US T N/B 4.25 09/30/24	2,200,000.000	2,172,628.890	
	US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,954,218.750	
	US T N/B 4.25 11/15/40	1,300,000.000	1,319,195.300	
	US T N/B 4.25 12/31/24	5,500,000.000	5,427,597.670	
	US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	939,006.250	
	US T N/B 4.375 05/15/41	930,000.000	955,175.380	
	US T N/B 4.375 10/31/24	2,070,000.000	2,046,793.350	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,034,218.750	
	US T N/B 4.5 02/15/36	900,000.000	952,980.460	
	US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	631,992.170	
	US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,029,650.770	
	US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,549,500.380	
	US T N/B 4.5 11/30/24	4,200,000.000	4,158,574.220	
	US T N/B 4.625 02/15/40	1,890,000.000	2,012,333.180	
	US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,629,574.600	
	US T N/B 4.75 02/15/41	830,000.000	894,681.640	
	US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	616,115.040	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	888,216.790	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,160,000.000	2,339,803.130	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,477,531.240	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,200,000.000	1,284,375.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	852,600.110	
アメリカ・ドル	小計	857,070,000.000 (121,241,122,200)	759,286,432.940 (107,408,658,804)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,150,000.000	1,012,202.400	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,078,740.200	
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,400,000.000	2,219,515.200	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,587,824.000	

UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,130,000.000	1,820,229.840	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	900,018.400	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,980,000.000	1,561,230.000	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	554,296.180	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	970,162.450	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,850,000.000	1,165,289.100	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,190,000.000	457,122.790	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,670,000.000	779,556.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,300,000.000	911,205.100	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,260,000.000	1,000,621.940	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,970,000.000	2,216,707.020	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,210,000.000	729,298.940	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	269,596.800	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	949,146.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	815,599.850	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,600,000.000	922,956.040	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,100,000.000	988,123.400	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	540,542.390	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,110,000.000	551,448.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	877,417.860	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	444,918.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	386,273.700	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	1,130,000.000	638,743.800	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	593,589.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	962,683.420	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,032,688.500	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	797,375.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,840,000.000	1,475,462.880	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	1,300,000.000	1,162,005.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,450,000.000	1,201,455.500	



	UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	766,548.930	
	UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,430,110.080	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	400,000.000	356,252.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	829,974.270	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,400,000.000	1,192,170.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	819,781.200	
	UK TREASURY 4.0 10/22/63	520,000.000	474,510.760	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,390,000.000	2,295,284.770	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,500,000.000	1,436,667.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,820,000.000	1,777,721.400	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	997,770.780	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,110,000.000	1,074,844.950	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,002,926.820	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	1,000,884.600	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	944,569.260	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,141,110.120	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,183,639.680	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,565,000.000	1,512,040.400	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,395,000.000	1,403,439.750	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,080,000.000	1,078,272.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,785,000.000	1,775,544.850	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	714,669.800	
	イギリス・ポンド 小計	75,144,000.000 (13,679,213,760)	58,782,778.120 (10,700,816,929)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	320,000.000	303,474.240	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	830,000.000	753,178.520	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,762,443.900	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,375,996.480	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	200,000.000	161,920.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,720,000.000	1,262,263.280	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75	2,000,000.000	1,894,494.000	

	08/31/25			
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	560,000.000	426,756.960	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,560,000.000	1,452,962.160	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,172,125.120	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,910,000.000	1,789,494.280	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,110,000.000	1,309,476.990	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,298,942.540	
イスラエル・シケル 小計		18,540,000.000 (709,056,738)	16,963,528.470 (648,765,057)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,990,000.000	1,881,240.750	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,329,104.030	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,815,000.000	1,615,605.630	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,170,000.000	1,675,136.580	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,326,611.750	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,658,382.040	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,810,000.000	1,476,033.930	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,720,000.000	979,196.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,491,986.530	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	730,000.000	667,731.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,624,666.970	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,020,000.000	803,281.780	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	554,985.820	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,349,777.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	950,000.000	885,058.390	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,289,050.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	940,000.000	733,920.410	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	2,270,000.000	2,027,725.100	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,700,000.000	1,667,501.170	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,500,000.000	1,426,751.210	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	707,827.150	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	800,000.000	741,752.640	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	774,967.400	
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,400,000.000	1,334,314.440		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,600,726.220		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,460,000.000	1,485,348.800		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,590,000.000	1,620,679.050		
オーストラリア・ドル 小計		39,515,000.000 (3,738,909,300)	34,729,361.790 (3,286,092,213)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	10,000,000.000	9,997,618.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	19,995,685.390	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,490,000.000	8,506,445.970	

2.24 05/25/25			
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.26 02/24/25	49,500,000.000	49,628,086.200	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,846,666.500	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.3 05/15/26	15,000,000.000	15,031,494.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.44 10/15/27	26,000,000.000	26,037,494.600	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,383,839.410	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,198,253.950	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,488,358.070	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.6 09/01/32	14,300,000.000	14,184,908.450	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.62 09/25/29	17,500,000.000	17,512,955.250	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,619,163.100	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,922,673.960	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.69 08/15/32	13,000,000.000	12,990,909.360	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.75 02/17/32	20,000,000.000	20,083,856.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.75 06/15/29	15,000,000.000	15,146,440.500	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.76 05/15/32	3,000,000.000	3,014,144.700	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.79 12/15/29	26,000,000.000	26,261,700.400	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,155,460.800	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,109,796.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 11/15/32	33,300,000.000	33,534,405.360	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.85 06/04/27	18,500,000.000	18,821,570.700	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,163,317.940	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.91 10/14/28	22,100,000.000	22,575,147.790	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.01 05/13/28	15,000,000.000	15,411,342.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.02 05/27/31	13,000,000.000	13,347,898.200	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.03 03/11/26	40,000,000.000	40,872,992.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	7,500,000.000	7,608,753.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,273,046.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	12,450,000.000	12,817,856.410	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,633,698.950	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	20,320,000.000	21,232,908.510	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	7,100,000.000	7,508,334.490	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	16,450,000.000	17,827,138.070	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,282,394.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	6,600,000.000	7,381,820.160	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	11,500,000.000	13,034,347.250	
	オフショア・人民元 小計	629,020,000.000 (12,313,884,226)	639,442,923.090 (12,517,926,495)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,265,153.180	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,117,230.500	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,300,000.000	1,839,337.390	
	CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	769,979.080	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	492,651.060	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,151,915.970	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	661,781.940	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,210,000.000	1,094,853.060	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,583,103.450	
	CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,040,716.170	
	CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	648,554.570	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,770,000.000	2,373,667.130	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	423,123.020	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,620,000.000	2,228,506.630	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,530,870.680	
	CANADA 2.0 06/01/28	830,000.000	765,778.010	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,940,000.000	1,710,648.720	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,260,000.000	2,464,092.840	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,263,813.870	
	CANADA 2.25 06/01/29	230,000.000	213,284.880	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,000,000.000	922,289.970	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,394,585.450	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,180,000.000	1,105,290.960	
	CANADA 2.75 08/01/24	590,000.000	576,009.620	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,250,000.000	1,191,049.290	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,060,000.000	950,147.680	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	340,095.670	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,400,000.000	1,350,002.360	

	CANADA 3.0 10/01/25	1,760,000.000	1,701,039.450	
	CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	838,651.110	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,130,000.000	1,110,610.230	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	391,254.280	
	CANADA 3.5 12/01/45	680,000.000	689,300.630	
	CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,140,792.830	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	610,209.920	
	CANADA 5.0 06/01/37	380,000.000	441,438.700	
	CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	820,744.890	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	721,414.950	
カナダ・ドル 小計		46,480,000.000 (4,956,627,200)	41,933,990.140 (4,471,840,709)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	480,000.000	448,176.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	476,595.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	740,000.000	657,860.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	416,500.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	441,264.750	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	940,000.000	906,348.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	890,000.000	807,675.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	762,496.800	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	174,618.550	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	331,160.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	360,000.000	360,360.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	655,446.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	578,495.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	197,340.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	606,360.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	139,312.500	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	370,000.000	367,264.550	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	330,000.000	334,950.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	804,640.000	
シンガポール・ドル 小計		9,925,000.000 (1,045,003,250)	9,466,862.150 (996,765,916)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,027,797.360	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,067,438.600	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,010,000.000	2,663,745.630	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	8,210,000.000	7,657,430.360	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,500,000.000	2,302,500.000	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	3,912,939.400	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,813,844.960	
SWEDEN 3.5 03/30/39	3,370,000.000	3,684,993.900		
スウェーデン・クローナ 小計		35,370,000.000 (465,469,200)	33,130,690.210 (435,999,883)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,200,000.000	2,101,991.150	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,580,000.000	3,623,569.490	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,260,000.000	2,119,507.620	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	5,718,594.100	

	DENMARK 0.5 11/15/29	4,790,000.000	4,142,030.430	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,540,000.000	5,354,134.650	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,330,000.000	9,992,633.010	
デンマーク・クローネ 小計		36,050,000.000 (753,084,500)	33,052,460.450 (690,465,899)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	520,283.280	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	509,519.480	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	580,000.000	452,980.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	244,269.480	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	440,000.000	349,902.930	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	720,000.000	686,217.860	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	627,972.400	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	440,000.000	291,066.380	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	350,000.000	316,718.330	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	402,007.090	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	122,551.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	785,524.070	
ニュージーランド・ドル 小計		6,350,000.000 (558,609,500)	5,309,012.300 (467,033,812)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,172,483.250	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,510,000.000	3,820,195.500	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,277,674.700	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,600,000.000	3,328,560.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,085,681.850	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,578,520.600	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,898,293.500	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,630,000.000	2,296,371.350	
NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,705,700.000		
ノルウェー・クローネ 小計		29,120,000.000 (393,702,400)	26,163,480.750 (353,730,260)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,587,002.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,470,000.000	4,111,953.000	
	POLAND 07/25/24	1,710,000.000	1,613,319.050	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,370,000.000	3,273,304.800	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,920,000.000	2,872,380.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	2,057,700.500	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,557,620.900	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,105,946.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,063,691.600	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,519,801.500	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,427,167.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	2,190,000.000	2,216,718.000	

	POLAND 7.5 07/25/28	2,100,000.000	2,272,432.260	
ポーランド・ズロチ 小計		36,640,000.000 (1,284,744,960)	32,679,037.110 (1,145,857,757)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	1,006,172.370	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	646,460.890	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,364,876.250	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,999,789.480	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,430,170.200	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,788,491.560	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,646,251.880	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	1,350,000.000	1,359,356.170	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	702,682.680	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,007,632.900	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,746,892.230	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,680,747.000	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	920,000.000	929,793.210	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,750,000.000	2,773,034.270	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,900,000.000	1,858,334.090	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	684,857.710	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	600,000.000	611,296.440	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,074,961.650	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,000,000.000	1,039,008.000	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,249,110.000	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,053,326.400	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	1,008,374.550	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,600,000.000	1,719,410.550	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	323,418.210		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,100,000.000	1,178,523.390		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,198,006.130		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,757,708.640		
マレーシア・リンギット 小計		37,150,000.000 (1,126,934,105)	37,838,686.850 (1,147,825,214)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	19,580,000.000	17,191,631.600	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	11,680,000.000	10,788,232.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	9,790,000.000	8,876,201.400	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	11,290,000.000	10,071,470.300	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,954,406.300	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	21,702,000.000	21,552,741.010	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	35,282,000.000	32,004,957.370	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	28,146,000.000	26,480,601.180	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	31,148,000.000	29,062,641.400	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	21,007,000.000	18,482,378.740	
	MEXICAN BONDS 7.75	6,835,000.000	6,270,702.400	

	11/23/34			
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,373,111.490	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	21,061,000.000	18,948,371.090	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,726,992.630	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	16,642,000.000	15,949,859.220	
メキシコ・ペソ 小計		281,877,000.000 (2,338,507,967)	262,734,298.130 (2,179,696,284)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	930,000.000	756,541.050	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,310,000.000	1,030,003.220	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	1,090,000.000	1,027,442.720	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	570,000.000	483,616.500	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	256,590.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	380,000.000	256,804.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,420,000.000	1,228,977.340	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	969,719.600	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	172,584.990	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	935,000.000	839,670.200	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	324,512.980	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,101,531.830	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	120,708.420	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	900,000.000	745,209.900	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	898,189.260	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	522,266.980	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	105,659.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	930,000.000	910,132.410	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	390,000.000	293,856.810	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	260,000.000	251,014.920	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	269,568.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	770,000.000	709,130.730	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	800,000.000	775,440.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	540,000.000	528,795.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	344,427.360	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,110,000.000	1,201,242.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,110,000.000	1,155,607.680	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	686,094.000	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	508,648.980	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	724,970.300	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	651,840.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	1,450,000.000	1,127,520.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	750,000.000	454,860.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	650,000.000	625,787.500	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	336,843.120		
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,980,000.000	1,887,274.620		
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,260,000.000	1,151,910.900		
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,440,000.000	1,288,224.000		
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,500,000.000	1,326,295.500		



BELGIUM 1. 0 06/22/26	1, 560, 000. 000	1, 464, 996. 000	
BELGIUM 1. 0 06/22/31	1, 270, 000. 000	1, 079, 726. 060	
BELGIUM 1. 25 04/22/33	810, 000. 000	679, 401. 270	
BELGIUM 1. 4 06/22/53	1, 490, 000. 000	904, 535. 790	
BELGIUM 1. 45 06/22/37	380, 000. 000	297, 960. 280	
BELGIUM 1. 6 06/22/47	920, 000. 000	632, 086. 000	
BELGIUM 1. 7 06/22/50	980, 000. 000	666, 468. 600	
BELGIUM 1. 9 06/22/38	610, 000. 000	498, 822. 010	
BELGIUM 2. 15 06/22/66	450, 000. 000	316, 800. 000	
BELGIUM 2. 25 06/22/57	390, 000. 000	292, 266. 390	
BELGIUM 2. 75 04/22/39	220, 000. 000	200, 109. 360	
BELGIUM 3. 0 06/22/33	500, 000. 000	487, 271. 310	
BELGIUM 3. 0 06/22/34	680, 000. 000	659, 322. 560	
BELGIUM 3. 3 06/22/54	270, 000. 000	253, 520. 140	
BELGIUM 3. 75 06/22/45	740, 000. 000	761, 765. 620	
BELGIUM 4. 0 03/28/32	630, 000. 000	666, 729. 000	
BELGIUM 4. 25 03/28/41	1, 280, 000. 000	1, 401, 505. 280	
BELGIUM 4. 5 03/28/26	1, 070, 000. 000	1, 104, 663. 720	
BELGIUM 5. 0 03/28/35	1, 620, 000. 000	1, 868, 734. 800	
BELGIUM 5. 5 03/28/28	1, 570, 000. 000	1, 734, 719. 690	
BUNDESOBL 0. 0 04/10/26	3, 010, 000. 000	2, 770, 012. 700	
BUNDESOBL 0. 0 04/11/25	1, 590, 000. 000	1, 503, 099. 350	
BUNDESOBL 0. 0 04/16/27	1, 460, 000. 000	1, 312, 984. 060	
BUNDESOBL 0. 0 10/09/26	1, 860, 000. 000	1, 691, 651. 400	
BUNDESOBL 0. 0 10/10/25	2, 450, 000. 000	2, 283, 302. 000	
BUNDESOBL 0. 0 10/10/25	1, 350, 000. 000	1, 260, 144. 000	
BUNDESOBL 1. 3 10/15/27	1, 880, 000. 000	1, 766, 805. 200	
BUNDESOBL 1. 3 10/15/27	700, 000. 000	659, 323. 000	
BUNDESOBL 10/18/24	1, 590, 000. 000	1, 523, 275. 810	
BUNDESOBL 2. 2 04/13/28	1, 800, 000. 000	1, 754, 136. 000	
BUNDESSCHAT 0. 4 09/13/24	900, 000. 000	869, 040. 000	
BUNDESSCHAT 2. 2 12/12/24	1, 350, 000. 000	1, 327, 995. 000	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/30	1, 520, 000. 000	1, 280, 144. 000	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/31	2, 340, 000. 000	1, 924, 626. 600	
DEUTSCHLAND 0. 0 02/15/32	2, 900, 000. 000	2, 327, 453. 000	
DEUTSCHLAND 0. 0 05/15/35	1, 660, 000. 000	1, 212, 762. 800	
DEUTSCHLAND 0. 0 05/15/36	1, 780, 000. 000	1, 263, 337. 200	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/30	2, 430, 000. 000	2, 023, 169. 400	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/30	590, 000. 000	491, 859. 400	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/31	3, 190, 000. 000	2, 592, 800. 100	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/31	800, 000. 000	651, 180. 550	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/50	3, 140, 000. 000	1, 581, 410. 760	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/50	710, 000. 000	358, 834. 000	
DEUTSCHLAND 0. 0 08/15/52	2, 040, 000. 000	974, 589. 600	
DEUTSCHLAND 0. 0 11/15/27	1, 620, 000. 000	1, 438, 057. 800	
DEUTSCHLAND 0. 0 11/15/28	2, 060, 000. 000	1, 787, 334. 940	
DEUTSCHLAND 0. 25 02/15/27	2, 120, 000. 000	1, 932, 401. 200	
DEUTSCHLAND 0. 25 02/15/29	2, 830, 000. 000	2, 478, 151. 760	

DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,570,000.000	2,272,496.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,818,262.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,360,000.000	3,146,673.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,940,000.000	1,753,934.600	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,310,000.000	2,107,493.850	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,590,000.000	2,367,640.730	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,990,000.000	1,697,030.210	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	960,000.000	758,236.800	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,820,000.000	1,774,245.200	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,312,939.200	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,670,000.000	2,015,770.210	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,430,000.000	1,325,152.400	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,350,000.000	1,116,207.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,400,000.000	2,319,384.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	950,000.000	923,029.500	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,370,000.000	2,295,890.100	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,170,000.000	2,117,197.390	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,429,949.500	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,130,000.000	2,433,972.300	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	2,025,652.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,288,819.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,820,000.000	2,176,811.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	2,042,961.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,820,000.000	3,357,633.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,465,038.500	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	944,361.600	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	964,061.500	
FINLAND 0.0 09/15/24	410,000.000	393,529.070	
FINLAND 0.0 09/15/26	430,000.000	388,763.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	168,431.080	
FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	188,096.760	
FINLAND 0.125 04/15/52	660,000.000	289,677.960	
FINLAND 0.125 09/15/31	400,000.000	313,586.400	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	174,646.410	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	427,839.100	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	227,090.860	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	359,268.150	
FINLAND 0.5 09/15/28	550,000.000	482,337.350	
FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	256,893.230	
FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	167,655.080	
FINLAND 0.875 09/15/25	910,000.000	864,144.190	

FINLAND 1. 125 04/15/34	480,000.000	388,647.680	
FINLAND 1. 375 04/15/27	110,000.000	103,059.550	
FINLAND 1. 375 04/15/47	480,000.000	337,213.980	
FINLAND 1. 5 09/15/32	550,000.000	476,791.150	
FINLAND 2. 625 07/04/42	430,000.000	391,328.810	
FINLAND 2. 75 04/15/38	170,000.000	158,099.880	
FINLAND 2. 75 07/04/28	490,000.000	482,821.500	
FINLAND 4. 0 07/04/25	510,000.000	515,559.000	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/25	2,190,000.000	2,072,327.790	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/26	3,130,000.000	2,877,061.570	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/27	3,200,000.000	2,859,774.910	
FRANCE OAT 0. 0 05/25/32	3,990,000.000	3,040,380.000	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/29	2,890,000.000	2,386,851.000	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/30	4,780,000.000	3,826,509.500	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/31	4,070,000.000	3,155,340.760	
FRANCE OAT 0. 25 11/25/26	2,920,000.000	2,650,393.480	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/25	3,730,000.000	3,535,975.640	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/26	3,760,000.000	3,483,416.270	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/29	4,190,000.000	3,621,175.020	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/40	2,150,000.000	1,354,103.840	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/72	790,000.000	286,991.200	
FRANCE OAT 0. 5 06/25/44	1,590,000.000	905,684.670	
FRANCE OAT 0. 75 02/25/28	4,280,000.000	3,851,144.000	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/28	5,110,000.000	4,575,267.250	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/52	3,770,000.000	1,941,761.120	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/53	2,350,000.000	1,180,193.500	
FRANCE OAT 0. 75 11/25/28	4,500,000.000	3,990,199.800	
FRANCE OAT 03/25/25	3,970,000.000	3,747,828.870	
FRANCE OAT 1. 0 05/25/27	3,060,000.000	2,824,259.610	
FRANCE OAT 1. 0 11/25/25	2,740,000.000	2,598,369.400	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/34	2,860,000.000	2,343,770.000	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/36	4,080,000.000	3,196,680.000	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/38	300,000.000	225,390.000	
FRANCE OAT 1. 5 05/25/31	5,380,000.000	4,807,003.100	
FRANCE OAT 1. 5 05/25/50	2,970,000.000	1,966,080.600	
FRANCE OAT 1. 75 05/25/66	990,000.000	636,193.800	
FRANCE OAT 1. 75 06/25/39	2,570,000.000	2,063,193.430	
FRANCE OAT 1. 75 11/25/24	2,380,000.000	2,325,597.030	
FRANCE OAT 2. 0 05/25/48	2,250,000.000	1,703,939.940	
FRANCE OAT 2. 0 11/25/32	2,100,000.000	1,906,800.000	
FRANCE OAT 2. 5 05/25/30	4,550,000.000	4,400,791.210	
FRANCE OAT 2. 5 05/25/43	250,000.000	214,867.750	
FRANCE OAT 2. 5 09/24/26	520,000.000	508,332.760	
FRANCE OAT 2. 75 02/25/29	700,000.000	687,227.800	
FRANCE OAT 2. 75 10/25/27	3,890,000.000	3,834,738.660	
FRANCE OAT 3. 25 05/25/45	2,340,000.000	2,262,997.620	
FRANCE OAT 3. 5 04/25/26	3,300,000.000	3,321,780.000	
FRANCE OAT 4. 0 04/25/55	1,530,000.000	1,673,361.000	
FRANCE OAT 4. 0 04/25/60	1,170,000.000	1,294,295.180	
FRANCE OAT 4. 0 10/25/38	1,940,000.000	2,079,251.260	

FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,940,000.000	3,355,072.140	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,530,000.000	2,883,972.300	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,500,000.000	3,940,076.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,028,754.250	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,296,066.150	
IRISH 0.0 10/18/31	870,000.000	679,365.600	
IRISH 0.2 05/15/27	520,000.000	465,461.610	
IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	448,945.750	
IRISH 0.35 10/18/32	400,000.000	313,698.260	
IRISH 0.4 05/15/35	270,000.000	196,805.160	
IRISH 0.55 04/22/41	350,000.000	219,241.750	
IRISH 0.9 05/15/28	610,000.000	551,970.560	
IRISH 1.0 05/15/26	900,000.000	848,056.320	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	654,949.590	
IRISH 1.3 05/15/33	90,000.000	76,287.240	
IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	320,275.800	
IRISH 1.5 05/15/50	570,000.000	382,726.500	
IRISH 1.7 05/15/37	680,000.000	557,081.840	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	659,579.760	
IRISH 2.4 05/15/30	860,000.000	827,717.320	
IRISH 3.0 10/18/43	410,000.000	389,805.450	
IRISH 5.4 03/13/25	920,000.000	951,331.400	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,822,242.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,150,000.000	1,024,880.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,460,000.000	1,401,337.200	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,288,736.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,235,744.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,706,306.850	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,500,000.000	1,238,250.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,480,369.240	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	931,040.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,520,000.000	1,158,014.060	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,544,557.500	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,668,971.550	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,980,000.000	1,290,564.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,980,000.000	1,513,116.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,095,525.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,494,696.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,320,730.000	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	996,490.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,288,192.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,830,000.000	1,682,269.590	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,561,337.100	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	804,048.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,880,000.000	1,802,357.880	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	680,000.000	659,325.280	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	475,065.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,760,000.000	1,686,111.220	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,250,000.000	2,114,550.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,290,000.000	1,880,416.320	

ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,472,884.840	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,320,000.000	750,160.310	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	778,090.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,194,665.600	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,840,000.000	2,620,477.140	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,592,175.720	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.000	1,399,796.080	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,290,000.000	1,227,015.750	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	201,528.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	317,628.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,497,780.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,069,504.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,830,000.000	1,557,527.640	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	786,370.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,505,726.280	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,608,933.310	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,165,398.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,820,000.000	1,729,910.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	990,000.000	733,491.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	476,700.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,125,480.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,740,000.000	1,647,595.560	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,261,600.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,310,000.000	1,242,684.340	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,260,000.000	1,051,049.240	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	519,180.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	968,827.200	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,020,000.000	922,113.660	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	550,000.000	538,450.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,001,715.820	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,710,000.000	1,696,320.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,108,241.800	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,618,689.610	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,000,000.000	998,350.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	950,000.000	849,826.370	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,800,000.000	1,780,560.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,170,000.000	2,078,209.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	960,000.000	930,912.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	800,000.000	792,720.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	750,000.000	758,625.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,200,000.000	1,175,640.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,510,000.000	2,552,419.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	370,000.000	360,935.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,680,000.000	2,784,195.720	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,360,000.000	1,389,127.120	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	570,164.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,750,636.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,090,000.000	2,202,651.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,250,000.000	1,318,625.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,140,000.000	2,294,508.000	

ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,628,630.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,796,696.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,510,000.000	1,668,550.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	386,645.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	2,460,000.000	2,272,206.550	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,080,000.000	971,121.960	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,110,000.000	943,993.270	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	355,767.050	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,000,000.000	455,119.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	571,801.300	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,400,000.000	1,112,230.920	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,390,000.000	1,309,387.460	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,060,000.000	904,488.460	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,110,000.000	753,024.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,420,000.000	1,314,281.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,100,000.000	890,381.640	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,061,730.600	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,327,838.240	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	542,559.600	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,069,546.050	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	450,000.000	433,041.300	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,510,000.000	1,472,121.900	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,420,000.000	1,569,898.040	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,620,000.000	1,787,346.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,140,000.000	1,260,270.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	2,050,000.000	1,940,632.500	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,503,333.880	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,610,000.000	1,426,218.500	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,780,000.000	1,525,905.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	814,405.260	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,880,000.000	1,444,780.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,041,429.960	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,000,000.000	1,648,296.000	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,288,621.800	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,289,349.360	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,456,135.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,750,000.000	1,578,500.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,300,000.000	1,112,865.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	900,000.000	610,749.000	
SPAIN 1.0 07/30/42	840,000.000	509,208.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,590,000.000	812,394.600	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	833,638.680	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,503,775.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,930,000.000	1,803,681.500	

	SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	1,980,676.180	
	SPAIN 1.4 07/30/28	1,670,000.000	1,515,441.500	
	SPAIN 1.45 04/30/29	1,900,000.000	1,706,933.400	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,715,139.980	
	SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	188,404.840	
	SPAIN 1.5 04/30/27	1,710,000.000	1,594,233.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,576,296.390	
	SPAIN 1.85 07/30/35	1,690,000.000	1,383,464.420	
	SPAIN 1.9 10/31/52	870,000.000	551,449.500	
	SPAIN 1.95 04/30/26	2,030,000.000	1,950,170.250	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,605,809.760	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,760,082.010	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,970,000.000	1,754,285.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,581,197.720	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,710,000.000	1,360,889.820	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,190,000.000	2,166,779.430	
	SPAIN 2.8 05/31/26	800,000.000	784,960.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,730,000.000	1,449,594.680	
	SPAIN 3.15 04/30/33	1,870,000.000	1,794,639.000	
	SPAIN 3.45 07/30/43	540,000.000	497,807.360	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	977,706.240	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,020,000.000	1,008,372.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,600,000.000	1,664,668.800	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,938,097.980	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,630,000.000	1,790,664.020	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,510,000.000	1,685,915.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,060,000.000	2,228,508.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,409,963.390	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,815,000.000	2,124,021.900	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,930,000.000	2,062,735.750	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,460,000.000	1,647,183.240	
	ユーロ 小計	527,217,000.000 (82,082,414,730)	473,731,401.240 (73,755,241,859)	
国債証券 合計		246,687,284,036.400 (246,687,284,036)	220,206,717,091 (220,206,717,091)	
合計			220,206,717,091 (220,206,717,091)	

(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 257銘柄	47.85	48.78
イギリス・ポンド	国債証券 56銘柄	4.77	4.86
イスラエル・シェケル	国債証券 13銘柄	0.29	0.29
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.46	1.49
オブショア・人民元	国債証券 38銘柄	5.58	5.68

カナダ・ドル	国債証券	38銘柄	1.99	2.03
シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	0.44	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.19	0.20
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.31	0.31
ニュージーランド・ドル	国債証券	12銘柄	0.21	0.21
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.16	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.51	0.52
マレーシア・リングgit	国債証券	27銘柄	0.51	0.52
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.97	0.99
ユーロ	国債証券	353銘柄	32.86	33.49

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式
	投資信託受益証券	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
	投資証券	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
	為替予約取引	原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	136,103,425,952円
同期中追加設定元本額	32,465,036,501円
同期中一部解約元本額	17,577,002,285円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,693,583,815円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	1,930,231円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	8,379,554円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	22,331,524円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	26,993,483円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	22,081,596円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	15,685,664円
たわらノーロード 先進国株式	48,640,775,751円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	316,152,881円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,881,790,349円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	859,953,854円
たわらノーロード バランス (堅実型)	83,363,008円
たわらノーロード バランス (標準型)	742,519,147円
たわらノーロード バランス (積極型)	959,971,615円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,335円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	34,007,692円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	217,730,256円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	223,196,319円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	382,893,442円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	293,555円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	14,050,802円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,564,460円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,025,785円
たわらノーロード 全世界株式	857,119,778円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,578,256,030円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	2,980,832,132円
O n e グローバルバランス	12,192,247円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	153,028,558円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	798,829,758円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,045,510,346円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	89,894,662円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	252,377,586円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	247,909,060円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,341,713円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	121,332,992円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	170,429,409円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	191,694,841円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	310,391,258円
投資のソムリエ	9,834,285,757円
クルーズコントロール	149,133,786円
投資のソムリエ<DC年金>	802,137,612円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	194,419,218円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	249,034,510円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	838,354,368円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,194,912,634円
ワールドアセットバランス (基本コース)	127,778,961円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	324,714,893円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	54,480,146円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	27,026,298円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	6,048,178円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	121,015,910円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	136,918,864円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	854,291,844円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	137,665,996円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	54,347,833円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	29,851,233円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	18,396,026円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	114,883,741円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,247,052円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	37,135,645円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	3,199,708円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	3,298,853円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	2,136,418円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	1,959,544円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	3,130,208円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	6,602,388円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	2,814,587円
MSCIコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	336,594,411円
DIAM外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	39,950,580円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,116,741,997円
DIAM先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,846,999円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,283,191,701円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	269,060,482円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	363,221円
DIAMワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	6,268,546円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	5,354,188円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,873,066円
DIAMグローバル・バランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	22,173,609円
DIAMグローバル・バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	45,427,485円
DIAM国際分散バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,564,117円
DIAM国際分散バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	10,515,441円
DIAM国内重視バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,034,194円
DIAM国内重視バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	31,524円
DIAM世界バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	905,376円
DIAM世界バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	16,223,472円
DIAMバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	129,647,427円
DIAMバランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	223,776,704円
DIAMバランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	760,845,590円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	34,084,689円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA２（適格機関投資家限定）	30,257,891円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	201,087,687円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	6,298,586円

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年7月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	39,532,305,407	
投資信託受益証券	△88,461,519	
投資証券	△1,180,111,372	
合計	38,263,732,516	

(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7月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年7月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	348,054,638	—	347,547,937	506,701
アメリカ・ドル	276,626,610	—	276,196,262	430,348
イギリス・ポンド	6,733,741	—	6,733,522	219
オーストラリア・ドル	15,493,947	—	15,420,759	73,188
カナダ・ドル	33,478,680	—	33,475,916	2,764
ユーロ	15,721,660	—	15,721,478	182
合計	348,054,638	—	347,547,937	506,701

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

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

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,291,490	127.130	164,187,123.700	
	ABBOTT LABORATORIES	243,695	107.020	26,080,238.900	
	AES CORP	90,680	21.020	1,906,093.600	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	126,834	132.900	16,856,238.600	
	ADVANCED MICRO DEVICES	225,800	113.580	25,646,364.000	
	ADOBE INC	64,328	496.350	31,929,202.800	
	CHUBB LTD	58,828	188.090	11,064,958.520	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	31,347	290.020	9,091,256.940	
	ALLSTATE CORP	36,651	106.750	3,912,494.250	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	93,182	207.740	19,357,628.680	
	AMGEN INC	75,197	224.730	16,899,021.810	
	HESS CORP	39,151	135.990	5,324,144.490	

AMERICAN EXPRESS CO	88,717	171.710	15,233,596.070
AMERICAN ELECTRIC POWER	72,574	84.340	6,120,891.160
AFLAC INC	83,202	69.570	5,788,363.140
AMERICAN INTL GROUP	101,141	58.080	5,874,269.280
ANALOG DEVICES	69,871	191.050	13,348,854.550
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	97,613	68.040	6,641,588.520
VALERO ENERGY CORP	52,681	112.610	5,932,407.410
ANSYS INC	12,049	332.210	4,002,798.290
APPLE INC	2,212,498	188.610	417,299,247.780
APPLIED MATERIALS INC	118,521	140.560	16,659,311.760
ALBEMARLE CORP	16,885	239.860	4,050,036.100
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	75,031	78.540	5,892,934.740
AMEREN CORP	38,938	82.100	3,196,809.800
ARROW ELECTRONICS INC	9,826	144.280	1,417,695.280
AUTODESK INC	29,554	207.330	6,127,430.820
AUTOMATIC DATA PROCESSING	57,207	224.260	12,829,241.820
AUTOZONE INC	2,591	2,513.560	6,512,633.960
AVERY DENNISON CORP	11,542	173.270	1,999,882.340
BALL CORP	45,691	56.030	2,560,066.730
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	181,302	341.130	61,847,551.260
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	114,977	44.110	5,071,635.470
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	45.650	3,256,534.050
BECTON DICKINSON & CO	40,101	257.560	10,328,413.560
AMETEK INC	30,909	157.520	4,868,785.680
VERIZON COMM INC	589,106	35.140	20,701,184.840
WR BERKLEY CORP	30,631	59.490	1,822,238.190
BEST BUY CO INC	29,593	79.880	2,363,888.840
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	389.460	1,176,558.660
YUM! BRANDS INC	38,365	134.810	5,171,985.650
FIRSTENERGY CORP	75,630	38.570	2,917,049.100
BOEING CO	79,978	213.310	17,060,107.180
ROBERT HALF INTL INC	14,456	79.040	1,142,602.240
BORGWARNER INC	29,975	44.810	1,343,179.750
BOSTON SCIENTIFIC CORP	198,509	52.700	10,461,424.300
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	96.230	1,658,331.590
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	22,659	143.940	3,261,536.460
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,083	1,293.600	3,988,168.800
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	296,148	62.480	18,503,327.040
ONEOK INC	63,913	62.400	3,988,171.200
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	117.700	1,142,749.300



UNITED RENTALS INC	9,916	444.970	4,412,322.520	
SEMPRA ENERGY	44,393	144.450	6,412,568.850	
FEDEX CORP	33,799	251.690	8,506,870.310	
VERISIGN INC	13,302	225.090	2,994,147.180	
AMPHENOL CORP	84,731	84.880	7,191,967.280	
BROWN-FORMAN CORP	43,429	65.530	2,845,902.370	
QUANTA SERVICES INC	19,621	199.790	3,920,079.590	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.610	469,136.650	
CSX CORP	285,564	33.610	9,597,806.040	
COTERRA ENERGY INC	112,611	25.520	2,873,832.720	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	45.990	1,240,718.220	
CONSTELLATION BRANDS INC	22,672	251.720	5,706,995.840	
CARDINAL HEALTH INC	34,421	93.690	3,224,903.490	
CARLISLE COS INC	7,522	260.410	1,958,804.020	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	19.300	2,553,216.300	
CATERPILLAR INC	72,483	248.810	18,034,495.230	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	124.560	1,573,317.360	
JPMORGAN CHASE & CO	410,128	145.150	59,530,079.200	
CHURCH & DWIGHT CO INC	34,837	98.290	3,424,128.730	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,671	97.400	2,208,155.400	
CINTAS CORP	12,807	489.490	6,268,898.430	
CISCO SYSTEMS INC	573,760	51.400	29,491,264.000	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	16.440	1,140,459.240	
CLOROX COMPANY	18,305	156.450	2,863,817.250	
COCA-COLA CO/THE	574,262	59.310	34,059,479.220	
COPART INC	58,789	90.290	5,308,058.810	
COGNEX CORP	25,772	55.810	1,438,335.320	
COLGATE-PALMOLIVE CO	112,540	75.890	8,540,660.600	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	36,790	190.940	7,024,682.600	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,749	301.950	2,641,760.550	
NRG ENERGY, INC.	28,364	37.830	1,073,010.120	
COMCAST CORP-CL A	589,933	41.850	24,688,696.050	
CONAGRA BRANDS INC	71,055	32.910	2,338,420.050	
CONSOLIDATED EDISON INC	48,354	91.390	4,419,072.060	
CMS ENERGY CORP	43,873	58.850	2,581,926.050	
COOPER COS INC	7,281	383.440	2,791,826.640	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	65.530	1,656,663.930	
CORNING INC	115,879	35.020	4,058,082.580	
WOLFSPEED INC	15,684	64.620	1,013,500.080	
SEALED AIR CORP	17,610	41.870	737,330.700	
HEICO CORP-CL A	9,463	138.550	1,311,098.650	
CUMMINS INC	19,320	253.010	4,888,153.200	
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	62.680	1,255,605.760	
DR HORTON INC	44,965	119.190	5,359,378.350	
DANAHER CORP	97,376	234.470	22,831,750.720	

MOODY'S CORP	23,345	342.100	7,986,324.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	70,798	66.640	4,717,978.720	
TARGET CORP	65,065	131.740	8,571,663.100	
DEERE & CO	39,519	407.090	16,087,789.710	
MORGAN STANLEY	175,687	83.400	14,652,295.800	
REPUBLIC SERVICES INC	30,250	150.890	4,564,422.500	
COSTAR GROUP INC	57,938	88.120	5,105,496.560	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	540.850	2,015,747.950	
THE WALT DISNEY CO	256,747	88.100	22,619,410.700	
DOLLAR TREE INC	30,183	144.900	4,373,516.700	
DOVER CORP	20,492	148.450	3,042,037.400	
OMNICOM GROUP	26,570	93.130	2,474,464.100	
DTE ENERGY CO	30,474	109.500	3,336,903.000	
DUKE ENERGY CORP	108,312	89.220	9,663,596.640	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,594	165.950	2,919,724.300	
EBAY INC	75,181	45.670	3,433,516.270	
BANK OF AMERICA CORP	1,009,900	28.660	28,943,734.000	
CITIGROUP INC	273,214	45.670	12,477,683.380	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	84.030	1,410,863.700	
EATON CORP PLC	56,036	203.060	11,378,670.160	
CADENCE DESIGN SYS INC	37,427	234.420	8,773,637.340	
ECOLAB INC	35,033	183.690	6,435,211.770	
REVVITY INC	17,972	116.980	2,102,364.560	
ELECTRONIC ARTS INC	37,893	130.540	4,946,552.220	
SALESFORCE INC	140,317	212.810	29,860,860.770	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	204.950	691,091.400	
EMERSON ELECTRIC CO	80,180	89.430	7,170,497.400	
ATMOS ENERGY CORP	21,185	117.580	2,490,932.300	
ENTERGY CORP	30,815	96.360	2,969,333.400	
EOG RESOURCES INC	80,746	115.770	9,347,964.420	
EQUIFAX INC	17,053	229.130	3,907,353.890	
EQT CORP	51,269	40.290	2,065,628.010	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	33,270	193.200	6,427,764.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,788	121.080	2,759,171.040	
EXXON MOBIL CORP	567,794	104.690	59,442,353.860	
FMC CORP	17,711	92.630	1,640,569.930	
NEXTERA ENERGY INC	283,426	71.710	20,324,478.460	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	395.430	2,140,067.160	
FAIR ISAAC CORP	3,376	802.380	2,708,834.880	
ASSURANT INC	8,276	126.040	1,043,107.040	
FASTENAL CO	78,930	58.850	4,645,030.500	
FIFTH THIRD BANCORP	102,090	26.670	2,722,740.300	
M&T BANK CORP	24,502	129.470	3,172,273.940	
FIRST HORIZON CORP	69,634	12.080	841,178.720	
FISERV INC	87,985	126.890	11,164,416.650	
FORD MOTOR CO	538,775	15.070	8,119,339.250	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	27.150	1,029,419.400	
FREEPORT-MCMORAN INC	200,156	38.980	7,802,080.880	

FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	1,286.000	2,040,882.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,820	215.590	6,428,893.800	
DENTSPLY SIRONA INC	33,798	39.580	1,337,724.840	
GENERAL DYNAMICS CORP	32,087	214.680	6,888,437.160	
GENERAL MILLS INC	83,996	74.790	6,282,060.840	
GENUINE PARTS CO	19,809	166.880	3,305,725.920	
GILEAD SCIENCES INC	172,546	75.690	13,060,006.740	
GARTNER INC	11,345	351.780	3,990,944.100	
MCKESSON CORP	19,309	414.760	8,008,600.840	
NVIDIA CORP	345,578	421.800	145,764,800.400	
GRACO INC	23,985	85.140	2,042,082.900	
GENERAL ELECTRIC CO	153,349	110.530	16,949,664.970	
WW GRAINGER INC	6,276	796.740	5,000,340.240	
HALLIBURTON CO	125,763	36.000	4,527,468.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	106,953	56.380	6,030,010.140	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	46,830	316.470	14,820,290.100	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	26,202	194.650	5,100,219.300	
HASBRO INC	21,174	64.080	1,356,829.920	
HENRY SCHEIN INC	17,431	80.040	1,395,177.240	
HEICO CORP	6,878	174.990	1,203,581.220	
HERSHEY FOODS CORP	20,089	241.910	4,859,729.990	
HP INC	124,613	31.540	3,930,294.020	
F5 INC	8,981	147.550	1,325,146.550	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	86.070	1,318,764.540	
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	223.140	1,388,377.080	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	31.100	1,359,536.500	
HOLOGIC INC	34,146	78.550	2,682,168.300	
HOME DEPOT INC	141,711	310.280	43,970,089.080	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	85.520	2,250,800.880	
HORMEL FOODS CORP	38,851	39.080	1,518,297.080	
CENTERPOINT ENERGY INC	94,813	29.460	2,793,190.980	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,776	324.640	1,550,480.640	
HUBBELL INC	6,903	335.430	2,315,473.290	
HUMANA INC	17,317	434.700	7,527,699.900	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,314	180.820	2,226,617.480	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	223,855	10.840	2,426,588.200	
BIOGEN INC	19,778	281.580	5,569,089.240	
IDEX CORP	11,156	216.970	2,420,517.320	
ILLINOIS TOOL WORKS	42,868	248.350	10,646,267.800	
INTUIT INC	39,473	464.330	18,328,498.090	
IDEXX LABORATORIES INC	11,400	521.210	5,941,794.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	31,231	193.600	6,046,321.600	
INTEL CORP	585,333	32.740	19,163,802.420	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	35,897	78.620	2,822,222.140	

INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	31.220	1,378,456.660	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	38.130	2,061,422.190	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,506	163.220	1,551,569.320	
INCYTE CORP	29,986	61.890	1,855,833.540	
JOHNSON & JOHNSON	363,483	159.510	57,979,173.330	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	44,033	72.500	3,192,392.500	
KLA CORPORATION	19,222	467.660	8,989,360.520	
DEVON ENERGY CORP	94,351	49.190	4,641,125.690	
KELLOGG CO	40,921	66.990	2,741,297.790	
KEYCORP	118,955	9.500	1,130,072.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	46,140	135.180	6,237,205.200	
BLACKROCK INC/NEW YORK	20,627	696.170	14,359,898.590	
KROGER CO	93,167	46.880	4,367,668.960	
LAM RESEARCH CORP	18,941	627.640	11,888,129.240	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	414.100	2,716,910.100	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,551	131.930	1,787,783.430	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	95.240	1,929,562.400	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,415	90.830	2,126,784.450	
LENNAR CORP	36,628	123.460	4,522,092.880	
ELI LILLY & CO	113,132	453.160	51,266,897.120	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	37.140	1,045,713.840	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	101,421	181.330	18,390,669.930	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	40,493	118.360	4,792,751.480	
LOCKHEED MARTIN CORP	31,757	460.380	14,620,287.660	
LOEWS CORP	29,698	59.540	1,768,218.920	
LOWE'S COS INC	83,658	229.120	19,167,720.960	
DOMINION ENERGY INC	114,318	51.580	5,896,522.440	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	45.500	1,838,245.500	
MCCORMICK & CO INC	35,510	83.320	2,958,693.200	
MCDONALD'S CORPORATION	101,881	294.490	30,002,935.690	
S&P GLOBAL INC	45,995	398.430	18,325,787.850	
EVEREST GROUP LTD	5,666	347.060	1,966,441.960	
MARKEL GROUP INC	1,713	1,368.470	2,344,189.110	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	87,575	91.640	8,025,373.000	
MARSH & MCLENNAN COS	69,406	184.910	12,833,863.460	
MASCO CORP	28,937	56.850	1,645,068.450	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	8,614	443.940	3,824,099.160	
METLIFE INC	90,251	57.410	5,181,309.910	
MEDTRONIC PLC	183,664	86.450	15,877,752.800	
ACTIVISION BLIZZARD INC	102,651	82.700	8,489,237.700	

CVS HEALTH CORP	177,420	69.360	12,305,851.200
MERCK & CO. INC.	355,630	109.960	39,105,074.800
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,157	95.980	5,677,888.860
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,455	210.480	2,411,048.400
MICROSOFT CORP	988,998	331.830	328,179,206.340
MICRON TECH INC	154,011	62.480	9,622,607.280
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	77,820	88.890	6,917,419.800
3M CO	78,686	97.190	7,647,492.340
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	107.100	675,908.100
ENTEGRIS INC	20,987	107.450	2,255,053.150
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	208.800	1,345,716.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,690	294.970	6,692,869.300
ILLUMINA INC	21,684	183.940	3,988,554.960
XCEL ENERGY INC	74,522	62.650	4,668,803.300
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,755	95.560	1,409,987.800
NETAPP INC	28,265	77.800	2,199,017.000
NEWMONT CORP	107,944	42.610	4,599,493.840
NVR INC	462	6,213.800	2,870,775.600
NIKE INC-CL B	173,258	105.780	18,327,231.240
NORDSON CORP	6,447	246.270	1,587,702.690
NORFOLK SOUTHERN CORP	31,621	228.930	7,238,995.530
EVERSOURCE ENERGY	48,081	70.380	3,383,940.780
NISOURCE INC	53,270	27.210	1,449,476.700
NORTHERN TRUST CORP	28,092	73.730	2,071,223.160
NORTHROP GRUMMAN CORP	20,365	452.590	9,216,995.350
WELLS FARGO & CO	528,110	42.320	22,349,615.200
NUCOR CORP	34,996	164.160	5,744,943.360
CHENIERE ENERGY INC	33,619	152.830	5,137,991.770
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	52,546	109.450	5,751,159.700
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,019	58.700	5,812,415.300
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,116	374.750	5,289,971.000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,516	961.090	8,184,642.440
ORACLE CORP	226,939	114.380	25,957,282.820
PACCAR INC	71,053	84.610	6,011,794.330
PTC INC	15,968	139.100	2,221,148.800
EXELON CORP	134,582	40.980	5,515,170.360
PARKER HANNIFIN CORP	17,462	392.640	6,856,279.680
PAYCHEX INC	44,228	116.480	5,151,677.440
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,597	343.700	3,642,188.900
PPL CORPORATION	102,363	25.960	2,657,343.480
PEPSICO INC	192,695	184.300	35,513,688.500
PENTAIR PLC	25,821	64.070	1,654,351.470
PFIZER INC	791,977	35.680	28,257,739.360

ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	39.190	1,285,275.240	
CONOCOPHILLIPS	170,235	104.350	17,764,022.250	
PG&E CORP	245,527	17.350	4,259,893.450	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	32,591	206.400	6,726,782.400	
ALTRIA GROUP INC	249,953	44.950	11,235,387.350	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	55,104	125.360	6,907,837.440	
BROWN & BROWN INC	35,984	68.670	2,471,021.280	
GARMIN LTD	19,911	106.090	2,112,357.990	
PPG INDUSTRIES INC	33,760	147.900	4,993,104.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	62,083	527.010	32,718,361.830	
T ROWE PRICE GROUP INC	31,190	113.040	3,525,717.600	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	139.760	2,031,551.360	
PROCTER & GAMBLE CO	330,357	148.860	49,176,943.020	
PROGRESSIVE CORP	81,255	131.080	10,650,905.400	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68,538	62.170	4,261,007.460	
PULTE GROUP INC	29,050	77.380	2,247,889.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,196	106.240	3,951,703.040	
QUALCOMM INC	156,400	117.120	18,317,568.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,105	103.990	3,026,628.950	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	94.910	2,219,565.260	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	7,931	279.390	2,215,842.090	
REGENERON PHARMACEUTICALS	14,886	703.360	10,470,216.960	
REPLIGEN CORP	6,730	143.420	965,216.600	
RESMED INC	20,171	216.610	4,369,240.310	
US BANCORP	213,414	33.740	7,200,588.360	
SEAGEN INC	20,184	192.210	3,879,566.640	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	51,936	74.710	3,880,138.560	
ROSS STORES INC	47,578	109.580	5,213,597.240	
ROLLINS INC	36,205	43.280	1,566,952.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,373	475.650	6,836,517.450	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,768	335.750	5,294,106.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	31,833	103.200	3,285,165.600	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	89.310	1,470,667.770	
ACCENTURE PLC-CL A	88,458	308.450	27,284,870.100	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	191,865	72.100	13,833,466.500	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,340	232.950	3,340,503.000	
AXON ENTERPRISE INC	9,177	195.360	1,792,818.720	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	31,733	169.070	5,365,098.310	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	82,528	58.390	4,818,809.920	
BOOKING HOLDINGS INC	5,209	2,728.830	14,214,475.470	

SCHLUMBERGER LTD	201,414	53.620	10,799,818.680
SCHWAB (CHARLES) CORP	207,590	57.830	12,004,929.700
POOL CORP	5,406	376.430	2,034,980.580
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,920	142.510	4,121,389.200
BUNGE LTD	21,715	100.180	2,175,408.700
SEI INVESTMENTS CO	14,477	59.520	861,671.040
ELEVANCE HEALTH INC	33,452	432.420	14,465,313.840
AMERISOURCEBERGEN CORP	23,804	192.830	4,590,125.320
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31,921	76.680	2,447,702.280
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	33,603	256.930	8,633,618.790
CENTENE CORP	78,244	67.310	5,266,603.640
SMITH (A. O. ) CORP	19,467	72.190	1,405,322.730
SNAP-ON INC	7,068	285.390	2,017,136.520
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	50,944	89.420	4,555,412.480
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	68.800	492,952.000
EDISON INTERNATIONAL	52,609	68.310	3,593,720.790
SOUTHERN CO	152,786	70.140	10,716,410.040
TRUIST FINANCIAL CORP	182,655	32.190	5,879,664.450
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	38.410	756,677.000
AT&T INC	1,000,163	15.270	15,272,489.010
CHEVRON CORP	251,757	155.250	39,085,274.250
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,889	93.670	2,144,012.630
STATE STREET CORP	50,667	74.500	3,774,691.500
STARBUCKS CORP	161,410	99.130	16,000,573.300
STEEL DYNAMICS INC	22,937	105.210	2,413,201.770
STRYKER CORP	47,233	295.300	13,947,904.900
NETFLIX INC	62,479	441.710	27,597,599.090
GEN DIGITAL INC	89,004	18.370	1,635,003.480
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,318	55.560	1,128,868.080
SYNOPSIS INC	21,524	445.720	9,593,677.280
SYSCO CORP	72,334	74.070	5,357,779.380
INTUITIVE SURGICAL INC	48,538	340.270	16,516,025.260
TELEFLEX INC	6,985	239.120	1,670,253.200
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	7.900	1,064,769.900
TERADYNE INC	22,066	109.420	2,414,461.720
TEXAS INSTRUMENTS INC	125,384	179.440	22,498,904.960
TEXTRON INC	25,824	68.040	1,757,064.960
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	54,155	516.850	27,990,011.750
GLOBE LIFE INC	12,153	111.760	1,358,219.280
TORO CO	14,644	102.100	1,495,152.400
DAVITA INC	6,813	103.690	706,439.970
TRACTOR SUPPLY CO	15,260	221.280	3,376,732.800
BIO-TECHNE CORP	20,652	82.840	1,710,811.680

TRIMBLE INC	36,251	52.810	1,914,415.310	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,996	413.120	2,477,067.520	
TYSON FOODS INC	41,316	50.900	2,102,984.400	
UGI CORP	33,476	25.850	865,354.600	
MARATHON OIL CORP	84,059	23.800	2,000,604.200	
UNION PACIFIC CORP	84,314	204.860	17,272,566.040	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	205,515	97.480	20,033,602.200	
UNITEDHEALTH GROUP INC	130,719	463.050	60,529,432.950	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	153.650	1,243,950.400	
VF CORP	51,762	18.610	963,290.820	
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	16.240	1,277,487.120	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	36,438	344.460	12,551,433.480	
VULCAN MATERIALS CO	18,430	219.390	4,043,357.700	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	98,551	29.790	2,935,834.290	
WALMART INC	207,310	154.880	32,108,172.800	
WASTE MANAGEMENT INC	57,379	171.130	9,819,268.270	
WATERS CORP	8,441	264.660	2,233,995.060	
WATSCO INC	4,889	374.830	1,832,543.870	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	39.400	878,029.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,639	377.300	4,014,094.700	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,386	146.370	2,252,048.820	
VAIL RESORTS INC	5,235	244.920	1,282,156.200	
WESTERN DIGITAL CORP	40,723	37.870	1,542,180.010	
WABTEC CORP	24,118	111.350	2,685,539.300	
WHIRLPOOL CORP	6,832	153.390	1,047,960.480	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	112.230	2,495,434.050	
WYNN RESORTS LTD	15,379	107.090	1,646,937.110	
NASDAQ INC	47,600	49.100	2,337,160.000	
CME GROUP INC	50,506	181.300	9,156,737.800	
WILLIAMS COS INC	166,525	32.910	5,480,337.750	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	135.080	1,155,069.080	
LKQ CORP	37,072	57.530	2,132,752.160	
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	52.040	1,767,590.640	
WEC ENERGY GROUP INC	43,488	88.510	3,849,122.880	
CARMAX INC	22,414	82.650	1,852,517.100	
TJX COMPANIES INC	161,812	83.570	13,522,628.840	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,764	306.160	2,377,026.240	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.770	588,304.730	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	48.960	1,151,930.880	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,146	199.810	3,425,942.260	
CBRE GROUP INC	41,089	83.340	3,424,357.260	



LIBERTY GLOBAL PLC	35,049	17.680	619,666.320
REGIONS FINANCIAL CORP	122,025	18.460	2,252,581.500
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	347.410	1,784,645.170
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,003	534.330	3,207,582.990
WESTLAKE CORP	4,187	121.490	508,678.630
T-MOBILE US INC	83,642	138.340	11,571,034.280
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	57.630	2,755,866.600
MOSAIC CO/THE	48,502	35.820	1,737,341.640
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	247.200	1,204,111.200
CELANESE CORP	13,613	116.890	1,591,223.570
DEXCOM INC	52,999	130.620	6,922,729.380
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,428	135.260	2,627,831.280
EXPEDIA GROUP INC	21,937	114.330	2,508,057.210
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	29,798	70.100	2,088,839.800
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,506	334.320	4,849,645.920
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	36,034	18.650	672,034.100
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	78,876	113.160	8,925,608.160
LIVE NATION	25,515	92.030	2,348,145.450
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,784	2,093.090	7,920,252.560
TRANSDIGM GROUP INC	7,625	881.490	6,721,361.250
MASTERCARD INC	119,102	392.160	46,707,040.320
OWENS CORNING	13,227	128.770	1,703,240.790
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	88.030	1,589,909.830
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	63.560	1,549,529.240
FIRST SOLAR INC	13,287	190.820	2,535,425.340
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,337	165.170	2,863,552.290
AECOM TECHNOLOGY CORP	17,000	86.490	1,470,330.000
DELTA AIR LINES INC	21,592	48.460	1,046,348.320
INSULET CORP	10,158	285.530	2,900,413.740
DISCOVER FINANCIAL	35,918	118.490	4,255,923.820
TE CONNECTIVITY LTD	43,069	141.240	6,083,065.560
MASIMO CORP	7,328	159.620	1,169,695.360
LULULEMON ATHLETICA INC	15,887	369.520	5,870,564.240
VMWARE INC	32,329	144.060	4,657,315.740
MERCADOLIBRE INC	6,425	1,087.150	6,984,938.750
ULTA BEAUTY INC	6,797	478.000	3,248,966.000
INVESCO LTD	57,267	17.370	994,727.790
MSCI INC	10,921	480.630	5,248,960.230
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	214,505	97.750	20,967,863.750
VISA INC	227,383	238.160	54,153,535.280
KEURIG DR PEPPER INC	130,795	31.460	4,114,810.700
AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,549	140.600	3,732,789.400

MARATHON PETROLEUM CORP	61,386	117.840	7,233,726.240	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	70.790	1,145,523.780	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	279,350	16.950	4,734,982.500	
XYLEM INC	33,760	111.740	3,772,342.400	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,537	91.130	3,420,746.810	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,330	227.870	1,442,417.100	
SPLUNK INC	20,626	104.480	2,155,004.480	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	234.950	1,917,661.900	
HCA HEALTHCARE INC	28,857	295.740	8,534,169.180	
VERISK ANALYTICS INC	20,276	226.980	4,602,246.480	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	123.810	964,727.520	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,298	256.310	2,639,480.380	
NXP SEMICONDUCTOR NV	36,905	210.420	7,765,550.100	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,741	112.610	2,223,034.010	
TARGA RESOURCES CORP	32,261	77.020	2,484,742.220	
LEAR CORP	9,620	146.960	1,413,755.200	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,261	136.000	2,075,496.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,899	59.620	2,080,678.380	
DOLLAR GENERAL CORP	30,721	168.990	5,191,541.790	
FORTINET INC	90,828	77.860	7,071,868.080	
HYATT HOTELS CORP	6,647	119.760	796,044.720	
HORIZON PHARMA PLC	31,608	102.630	3,243,929.040	
TESLA INC	399,181	269.610	107,623,189.410	
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	141.110	1,285,653.210	
ENPHASE ENERGY INC	18,723	175.470	3,285,324.810	
GENERAL MOTORS CO	193,897	39.640	7,686,077.080	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	26.890	1,054,894.700	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	10,655	221.150	2,356,353.250	
APTIV PLC	37,576	108.650	4,082,632.400	
PHILLIPS 66	64,680	100.330	6,489,344.400	
META PLATFORMS INC	309,915	294.100	91,146,001.500	
IQVIA HOLDINGS INC	25,473	219.430	5,589,540.390	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,714	134.090	3,313,900.260	
SERVICENOW INC	28,719	565.600	16,243,466.400	
PALO ALTO NETWORKS INC	42,685	247.470	10,563,256.950	
WORKDAY INC	28,345	222.400	6,303,928.000	
ABBVIE INC	247,235	134.490	33,250,635.150	
ZOETIS INC	65,387	170.220	11,130,175.140	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	19.570	1,060,909.270	
CDW CORP	18,651	187.380	3,494,824.380	
HOWMET AEROSPACE INC	55,049	50.240	2,765,661.760	
TWILIO INC	25,710	63.570	1,634,384.700	

SNAP INC	152,250	11.780	1,793,505.000
TRADE DESK INC A	61,854	75.910	4,695,337.140
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	28,191	73.650	2,076,267.150
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	33.430	664,287.530
OKTA INC	21,831	69.740	1,522,493.940
BLACK KNIGHT INC	21,663	60.500	1,310,611.500
BAKER HUGHES CO	137,839	33.230	4,580,389.970
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,514	112.240	2,414,731.360
BROADCOM INC	58,337	877.730	51,204,135.010
ARES MANAGEMENT CORP	23,111	93.720	2,165,962.920
MONGODB INC	10,029	394.620	3,957,643.980
BURLINGTON STORES INC	8,453	156.620	1,323,908.860
VEEVA SYSTEMS INC	20,611	199.840	4,118,902.240
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	44.540	1,110,738.520
EVERGY INC	33,192	58.030	1,926,131.760
ALLEGION PLC	13,423	118.560	1,591,430.880
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	66.690	1,221,360.660
STERIS PLC	14,147	223.050	3,155,488.350
DOCUSIGN INC	26,362	51.110	1,347,361.820
WIX.COM LTD	8,997	75.420	678,553.740
DROPBOX INC	45,227	27.360	1,237,410.720
KKR & CO INC	84,487	55.170	4,661,147.790
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	42.620	215,231.000
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	67.620	2,289,410.340
MODERNA INC	44,693	123.090	5,501,261.370
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	37,524	152.140	5,708,901.360
ARAMARK	31,133	42.520	1,323,775.160
CIGNA GROUP	41,150	278.340	11,453,691.000
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	54.870	1,798,089.900
DOW INC	96,707	53.270	5,151,581.890
OVINTIV INC	31,603	37.970	1,199,965.910
AMCOR PLC	226,283	9.710	2,197,207.930
PINTEREST INC	79,624	27.510	2,190,456.240
FOX CORP-A	36,501	33.700	1,230,083.700
FOX CORP-B	28,295	31.610	894,404.950
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	9.750	415,213.500
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	31,369	149.950	4,703,781.550
CHEWY INC	9,648	36.900	356,011.200
AVANTOR INC	97,157	20.680	2,009,206.760
DYNATRACE INC	32,648	52.770	1,722,834.960
CLOUDFLARE INC	35,474	65.480	2,322,837.520
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	65.710	906,798.000
CARRIER GLOBAL CORP	113,892	51.260	5,838,103.920
OTIS WORLDWIDE CORP	56,437	87.280	4,925,821.360
UBER TECHNOLOGIES INC	250,802	42.780	10,729,309.560
CORTEVA INC	97,725	54.090	5,285,945.250

MATCH GROUP INC	42,058	43.490	1,829,102.420	
FERGUSON PLC	27,517	155.210	4,270,913.570	
BILL HOLDINGS INC	14,365	118.570	1,703,258.050	
BLACKSTONE INC	99,622	93.370	9,301,706.140	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	196.170	1,044,016.740	
CARLYLE GROUP INC	24,530	31.940	783,488.200	
DATADOG INC	35,218	101.450	3,572,866.100	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	60.400	1,551,615.600	
INGERSOLL RAND INC	58,584	65.810	3,855,413.040	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	58,669	80.660	4,732,241.540	
PAYCOM SOFTWARE INC	7,334	334.870	2,455,936.580	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	25.510	2,383,297.260	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	39.960	1,232,326.440	
AON PLC	28,914	337.520	9,759,053.280	
WARNER BROS DISCOVERY INC	320,115	12.950	4,145,489.250	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,346.570	1,219,992.420	
BENTLEY SYSTEMS INC	28,502	52.530	1,497,210.060	
COINBASE GLOBAL INC	23,696	81.210	1,924,352.160	
UIPATH INC	53,439	17.070	912,203.730	
AIRBNB INC	57,463	131.710	7,568,451.730	
CONSTELLATION ENERGY CORP	44,942	93.600	4,206,571.200	
MONDAY.COM LTD	3,043	166.340	506,172.620	
ROYALTY PHARMA PLC	48,700	30.050	1,463,435.000	
ROBLOX CORP	59,573	41.630	2,480,023.990	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	25.850	1,083,218.400	
VIATRIS INC	150,826	9.930	1,497,702.180	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	33,177	50.730	1,683,069.210	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	82.840	1,312,682.640	
HF SINCLAIR CORP	20,299	45.270	918,935.730	
SNOWFLAKE INC	36,404	169.650	6,175,938.600	
DOORDASH INC	33,971	77.610	2,636,489.310	
ARISTA NETWORKS INC	36,116	159.550	5,762,307.800	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	55,400	75.800	4,199,320.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	254,570	16.300	4,149,491.000	
FNF GROUP	31,004	36.060	1,118,004.240	
JACOBS SOLUTIONS INC	16,615	122.250	2,031,183.750	
MARVELL TECHNOLOGY INC	121,827	60.290	7,344,949.830	
APA CORP	40,946	35.080	1,436,385.680	
LINDE PLC	68,660	367.550	25,235,983.000	
LUCID GROUP INC	143,927	7.930	1,141,341.110	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	52.220	625,647.820	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	172.390	641,463.190	

TOAST INC	45,399	22.820	1,036,005.180	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.450	964,326.750	
CATALENT INC	27,357	45.570	1,246,658.490	
SYNCHRONY FINANCIAL	65,868	33.950	2,236,218.600	
PHINIA INC	5,995	27.690	166,001.550	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	63,378	26.700	1,692,192.600	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	157.130	822,889.810	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,504	168.830	4,305,840.320	
HUBSPOT INC	6,653	529.940	3,525,690.820	
QORVO INC	14,144	103.840	1,468,712.960	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	81.300	1,246,735.500	
FORTREA HOLDINGS INC	11,455	30.650	351,095.750	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	7,789	264.990	2,064,007.110	
GODADDY INC	19,713	76.700	1,511,987.100	
ETSY INC	18,558	85.830	1,592,833.140	
TRANSUNION	25,708	77.590	1,994,683.720	
ALCOA CORP	23,941	34.140	817,345.740	
ALBERTSONS COS INC	40,041	22.000	880,902.000	
BLOCK INC	74,347	69.060	5,134,403.820	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,003	70.320	4,781,970.960	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	64.180	1,682,863.780	
WESTROCK CO	34,286	28.770	986,408.220	
KRAFT HEINZ CO	111,514	35.400	3,947,595.600	
NOVOCURE LTD	12,317	41.930	516,451.810	
FORTIVE CORP	49,865	74.020	3,691,007.300	
WASTE CONNECTIONS INC	35,315	138.690	4,897,837.350	
ALPHABET INC-CL A	835,893	116.450	97,339,739.850	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	173,258	16.990	2,943,653.420	
PAYPAL HOLDINGS INC	150,842	69.280	10,450,333.760	
SEA LTD ADR	50,316	58.040	2,920,340.640	
EQUITABLE HOLDINGS INC	56,768	27.340	1,552,037.120	
ZILLOW GROUP INC-C	22,374	47.910	1,071,938.340	
ALPHABET INC-CL C	748,535	116.870	87,481,285.450	
ZSCALER INC	12,304	154.270	1,898,138.080	
ATLASSIAN CORP PLC	19,972	173.490	3,464,942.280	
ROKU INC	15,660	67.870	1,062,844.200	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,423	372.540	5,000,604.420	
VISTRA CORP	49,633	26.460	1,313,289.180	
アメリカ・ドル 小計	47,523,023		5,341,291,657.030 (755,579,117,805)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	45,963	14.165	651,065.890	
ASHTREAD GROUP	63,076	52.020	3,281,213.520	

SEVERN TRENT PLC	31,034	24.320	754,746.880
BARCLAYS PLC	2,207,571	1.487	3,282,658.070
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.021	499,392.110
BT GROUP PLC	904,198	1.220	1,103,121.560
BUNZL PLC	46,691	28.890	1,348,902.990
AVIVA PLC	416,763	3.822	1,592,868.180
CRODA INTERNATIONAL	20,573	55.400	1,139,744.200
DIAGEO PLC	317,280	32.700	10,375,056.000
SCHRODERS PLC	110,366	4.256	469,717.690
DCC PLC	16,599	42.500	705,457.500
NATIONAL GRID PLC	518,265	9.888	5,124,604.320
KINGFISHER PLC	225,392	2.256	508,484.350
BAE SYSTEMS PLC	425,672	8.970	3,818,277.840
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	297,941	25.605	7,628,779.300
HALMA PLC	51,066	21.640	1,105,068.240
NEXT PLC	16,093	66.900	1,076,621.700
IMPERIAL BRANDS PLC	125,526	17.385	2,182,269.510
JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	16.980	339,192.480
ANGLO AMERICAN PLC	176,521	21.940	3,872,870.740
COMPASS GROUP PLC	240,717	20.700	4,982,841.900
HSBC HOLDINGS PLC	2,800,793	6.069	16,998,012.710
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.225	1,905,487.770
CENTRICA PLC	793,776	1.212	962,056.510
UNILEVER PLC	348,915	39.960	13,942,643.400
UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	9.410	852,254.290
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	53,779	20.100	1,080,957.900
PEARSON PLC	84,159	8.194	689,598.840
PERSIMMON PLC	56,474	9.932	560,899.760
PRUDENTIAL PLC	379,082	10.435	3,955,720.670
RIO TINTO PLC	159,931	48.685	7,786,240.730
VODAFONE GROUP PLC	3,279,277	0.706	2,315,169.560
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,637	57.720	5,635,607.640
RELX PLC	268,012	24.740	6,630,616.880
RENTOKIL INITIAL PLC	363,315	6.004	2,181,343.260
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	1.479	1,659,325.590
NATWEST GROUP PLC	783,143	2.332	1,826,289.470
ST JAMES' S PLACE PLC	89,082	10.750	957,631.500
SSE PLC	145,097	17.325	2,513,805.520
BP PLC	2,493,710	4.545	11,333,911.950
SAGE GROUP PLC (THE)	128,893	9.028	1,163,646.000
SMITHS GROUP PLC	51,695	15.860	819,882.700
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	100.150	1,076,712.650
STANDARD CHARTERED PLC	316,670	6.684	2,116,622.280
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,257,724	0.430	3,980,821.320

TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.006	573,282.170		
TESCO PLC	1,032,016	2.464	2,542,887.420		
3I GROUP PLC	143,794	18.710	2,690,385.740		
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	11.705	1,474,010.650		
GSK PLC	580,157	13.166	7,638,347.060		
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	55,432	80.800	4,478,905.600		
WPP PLC	142,785	8.152	1,163,983.320		
ASTRAZENECA PLC	217,329	101.800	22,124,092.200		
WHITBREAD PLC	25,470	33.240	846,622.800		
INTERTEK GROUP PLC	23,309	40.110	934,923.990		
BURBERRY GROUP PLC	52,229	20.340	1,062,337.860		
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,654	53.180	1,417,459.720		
SAINSBURY (J) PLC	283,091	2.679	758,400.780		
ADMIRAL GROUP PLC	32,350	20.670	668,674.500		
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	38.710	638,289.190		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	18.550	342,340.250		
ABRDN PLC	285,831	2.148	613,964.980		
EXPERIAN PLC	130,915	28.630	3,748,096.450		
MONDI PLC	58,887	12.100	712,532.700		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.882	291,176.840		
OCADO GROUP PLC	69,766	5.816	405,759.050		
INFORMA PLC	186,195	7.096	1,321,239.720		
GLENCORE PLC	1,480,027	4.331	6,409,996.930		
ENTAIN PLC	96,924	12.160	1,178,595.840		
COCA-COLA HBC AG	31,035	23.630	733,357.050		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,717	5.306	460,120.400		
M&G PLC	270,401	1.857	502,134.650		
ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	18.290	513,491.750		
WISE PLC	96,207	6.346	610,529.620		
JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.410	538,720.110		
HALEON PLC	703,324	3.114	2,190,150.930		
SHELL PLC	961,428	23.050	22,160,915.400		
AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.972	661,894.670		
イギリス・ポンド 小計	38,793,217		241,195,834.210 (43,907,289,660)		
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	30.570	5,728,940.280	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	228,914	27.900	6,386,700.600	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	771.200	2,568,096.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	131.200	1,649,708.800	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.280	2,978,616.320	
	ICL GROUP LTD	103,067	20.840	2,147,916.280	
	NICE LTD	9,053	745.300	6,747,200.900	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	123.300	2,150,352.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	206.700	965,702.400	
イスラエル・シュケル 小計	729,398		31,323,233.580		

				(1,197,947,671)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	55.210	1,562,774.260	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	478,692	20.840	9,975,941.280	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	234,609	21.230	4,980,749.070	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	4.230	2,042,476.650	
	ASX LTD	31,066	60.600	1,882,599.600	
	BHP GROUP LTD	702,811	42.720	30,024,085.920	
	AMPOL LTD	31,828	29.250	930,969.000	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	23.130	1,667,233.530	
	CSL LIMITED	67,397	264.120	17,800,895.640	
	REA GROUP LTD	6,134	139.830	857,717.220	
	TRANSURBAN GROUP	450,346	13.690	6,165,236.740	
	COCHLEAR LTD	8,356	221.900	1,854,196.400	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	8.460	1,803,917.340	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	234,232	98.520	23,076,536.640	
	RIO TINTO LIMITED	49,873	110.480	5,509,969.040	
	APA GROUP	164,300	9.540	1,567,422.000	
	ARISTOCRAT LEISU	89,945	36.490	3,282,093.050	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.720	2,059,669.040	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	38.380	2,332,237.460	
	IGO LTD	91,947	15.180	1,395,755.460	
	ORICA LTD	63,862	14.600	932,385.200	
	LEND LEASE CORP LTD	107,181	7.750	830,652.750	
	BLUESCOPE STEEL LTD	75,503	19.410	1,465,513.230	
	MACQUARIE GROUP LTD	50,698	171.280	8,683,553.440	
	SUNCORP GROUP LTD	199,708	13.310	2,658,113.480	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	447,363	25.640	11,470,387.320	
	NEWCREST MINING LTD	126,686	26.480	3,354,645.280	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.110	688,346.490	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	215,572	15.430	3,326,275.960	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	12.450	2,024,731.050	
	REECE LTD	31,558	17.780	561,101.240	
	SANTOS LTD	485,603	7.420	3,603,174.260	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	34.370	2,230,509.890	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	30.950	804,235.750	
WESFARMERS LTD	158,315	46.790	7,407,558.850		
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	264,886	34.000	9,006,124.000		
WOOLWORTHS GROUP LTD	169,400	38.420	6,508,348.000		
SEEK LTD	39,064	22.200	867,220.800		



	MINERAL RESOURCES LTD	28,198	66.840	1,884,754.320	
	BRAMBLES LTD	215,449	13.950	3,005,513.550	
	PILBARA MINERALS LTD	327,947	4.920	1,613,499.240	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.850	857,968.650	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	87,104	10.600	923,302.400	
	XERO LTD	18,860	116.280	2,193,040.800	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	21.170	951,019.910	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	5.060	1,473,826.200	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	6.100	1,425,204.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	410,226	23.260	9,541,856.760	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.430	1,415,735.930	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	3.560	2,124,230.640	
	COLES GROUP LTD	203,490	17.820	3,626,191.800	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	75.860	1,616,576.600	
	オーストラリア・ドル 小計	9,775,136		219,848,073.130 (20,802,024,680)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	67,555	65.650	4,434,985.750	
	BARRICK GOLD CORP	239,565	21.960	5,260,847.400	
	BANK OF MONTREAL	97,446	119.370	11,632,129.020	
	BANK OF NOVA SCOTIA	167,619	63.520	10,647,158.880	
	NATIONAL BANK OF CANADA	46,066	97.860	4,508,018.760	
	BCE INC	14,197	58.810	834,925.570	
	BROOKFIELD CORP	194,244	43.030	8,358,319.320	
	SAPUTO INC	34,582	28.140	973,137.480	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	10.260	947,110.860	
	DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	11,508	105.210	1,210,756.680	
	CGI INC	31,363	138.120	4,331,857.560	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	64.460	1,357,398.680	
	CAE INC	40,808	28.700	1,171,189.600	
	CAMECO CORP	54,264	40.300	2,186,839.200	
	ROGERS COMM-CL B	53,428	58.740	3,138,360.720	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	123,724	55.620	6,881,528.880	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	157,148	74.390	11,690,239.720	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,857	182.390	1,615,428.230	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	33.590	548,524.700	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	77,911	153.930	11,992,840.230	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	42.610	925,190.930	
	OPEN TEXT CORP	40,459	52.990	2,143,922.410	
	EMPIRE CO LTD	20,608	36.970	761,877.760	
	KINROSS GOLD CORP	193,561	6.370	1,232,983.570	
	RB GLOBAL INC	26,641	79.440	2,116,361.040	
	FORTIS INC	71,759	55.100	3,953,920.900	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	32.540	2,779,599.340	

TELUS CORP	31,890	25.440	811,281.600
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	38.340	1,311,534.720
IMPERIAL OIL LTD	27,246	64.570	1,759,274.220
ENBRIDGE INC	278,758	48.010	13,383,171.580
IGM FINANCIAL INC	12,478	39.860	497,373.080
MANULIFE FINANCIAL CORP	249,587	24.380	6,084,931.060
LOBLAW CO LTD	21,600	118.770	2,565,432.000
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	112,792	65.090	7,341,631.280
MAGNA INTERNATIONAL INC	41,868	77.250	3,234,303.000
SUN LIFE FINANCIAL INC	81,434	67.060	5,460,964.040
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,229	958.730	3,095,739.170
METRO INC	36,555	73.130	2,673,267.150
EMERA INC	36,998	52.950	1,959,044.100
ONEX CORP	10,157	73.590	747,453.630
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	19.640	1,087,525.720
POWER CORP OF CANADA	76,591	36.470	2,793,273.770
QUEBECOR INC-B	17,195	31.690	544,909.550
ROYAL BANK OF CANADA	191,414	125.270	23,978,431.780
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	130,948	103.560	13,560,974.880
SUNCOR ENERGY INC	185,738	38.830	7,212,206.540
LUNDIN MINING CORP	77,139	10.890	840,043.710
TECK RESOURCES LTD-CL B	66,934	55.430	3,710,151.620
THOMSON REUTERS CORP	22,378	174.180	3,897,800.040
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,698	107.400	1,471,165.200
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	256,228	81.030	20,762,154.840
TC ENERGY CORP	139,293	51.780	7,212,591.540
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	113.680	921,035.360
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	153.980	1,515,009.220
INTACT FINANCIAL CORP	24,452	197.580	4,831,226.160
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	69,100	56.110	3,877,201.000
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,805	2,615.110	7,335,383.550
FRANCO-NEVADA CORP NPR	26,282	186.860	4,911,054.520
TOURMALINE OIL CORP	46,466	64.690	3,005,885.540
KEYERA CORP	39,467	30.600	1,207,690.200
PARKLAND CORP	15,665	32.650	511,462.250
ALTAGAS LTD	33,833	23.720	802,518.760
PEMBINA PIPELINE CORP	81,652	40.240	3,285,676.480
DOLLARAMA INC	41,354	87.240	3,607,722.960
CENOVUS ENERGY INC W/I	202,950	23.100	4,688,145.000
ARC RESOURCES LTD	78,639	18.430	1,449,316.770
NORTHLAND POWER INC	34,152	26.250	896,490.000
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	20.050	1,027,422.150

	TMX GROUP LTD	35,200	29.200	1,027,840.000	
	BRP INC	4,307	108.110	465,629.770	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	12.410	1,226,356.200	
	NUTRIEN LTD	71,801	78.850	5,661,508.850	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	148.790	1,724,624.890	
	WSP GLOBAL INC	17,782	170.020	3,023,295.640	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,516	90.160	1,128,442.560	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	50.820	1,812,596.940	
	NUVEI CORP	7,929	38.910	308,517.390	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	41.450	667,469.350	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	41.970	2,192,890.530	
	AIR CANADA	41,444	24.890	1,031,541.160	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	41,208	100.360	4,135,634.880	
	SHOPIFY INC	165,568	82.190	13,608,033.920	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	203.880	1,067,719.560	
	HYDRO ONE LTD	46,225	36.800	1,701,080.000	
カナダ・ドル 小計		5,651,523		330,288,504.570 (35,221,966,127)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	314,100	3.560	1,118,196.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	244,510	30.910	7,557,804.100	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	112,300	6.720	754,656.000	
	SEATRUM LTD	7,235,222	0.130	940,578.860	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	33.650	521,575.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.320	930,136.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.940	715,521.420	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.470	1,196,303.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	459,198	12.090	5,551,703.820	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,092,930	2.480	2,710,466.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	7.310	1,189,337.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	169,266	27.400	4,637,888.400	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.530	284,708.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	14.550	637,290.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.680	951,280.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	431,290	3.250	1,401,692.500	
シンガポール・ドル 小計		11,628,809		31,099,136.500 (3,274,428,082)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	52.980	1,257,427.320	
	NESTLE SA-REGISTERED	384,822	105.580	40,629,506.760	
	CIE FINANC RICHEMONT	73,476	144.100	10,587,891.600	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	98,320	265.250	26,079,380.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART	5,311	198.300	1,053,171.300	

CERT				
SIKA INHABER	20,139	246.100	4,956,207.900	
SGS SA-REG	23,250	81.000	1,883,250.000	
NOVARTIS AG-REG SHS	287,449	85.780	24,657,375.220	
BALOISE HOLDING AG -R	5,830	130.200	759,066.000	
BARRY CALLEBAUT AG	460	1,667.000	766,820.000	
CLARIANT AG-REG	44,162	13.240	584,704.880	
SWISSCOM AG-REG	3,431	545.200	1,870,581.200	
ABB LTD	212,002	33.570	7,116,907.140	
ADECCO GROUP AG-REG	19,842	30.180	598,831.560	
GEBERIT AG	4,577	445.700	2,039,968.900	
LONZA GROUP AG-REG	10,240	528.600	5,412,864.000	
LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,650.000	1,459,050.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	105,600.000	1,689,600.000	
GIVAUDAN-REG	1,279	2,926.000	3,742,354.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,856	410.000	8,550,960.000	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	283.600	1,364,116.000	
HOLCIM LTD	75,608	57.180	4,323,265.440	
TEMENOS GROUP	7,082	69.000	488,658.000	
BACHEM HOLDING AG	4,673	75.050	350,708.650	
SONOVA HOLDING AG	6,984	231.500	1,616,796.000	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	261.000	2,059,290.000	
STRAUMANN HOLDING AG	16,536	137.650	2,276,180.400	
THE SWATCH GROUP AG-B	3,215	261.900	842,008.500	
THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	49.550	458,783.450	
HELVETIA HOLDING AG	4,906	121.800	597,550.800	
SCHINDLER NAMEN	4,276	190.400	814,150.400	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,593	514.200	2,361,720.600	
BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	96.050	470,933.150	
EMS-CHEMIE HOLDING	810	674.500	546,345.000	
SWISS PRIME SITE AG	13,636	78.500	1,070,426.000	
DUFREY GROUP	12,933	42.860	554,308.380	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,369	801.000	2,698,569.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	32,111	55.480	1,781,518.280	
SWISS RE LTD	41,653	88.600	3,690,455.800	
BKW AG	3,194	152.300	486,446.200	
SIG GROUP AG	38,322	24.780	949,619.160	
ALCON INC	68,865	72.620	5,000,976.300	
UBS GROUP AG	465,666	17.710	8,246,944.860	
VAT GROUP AG	4,053	359.200	1,455,837.600	
スイス・フラン 小計	2,078,680		190,201,525.750 (30,398,007,845)	
スウェーデン・ クローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	361,234	149.650	54,058,668.100	
ATLAS COPCO AB-B SHS	231,547	129.950	30,089,532.650	
ERICSSON LM-B SHS	418,000	58.050	24,264,900.000	
GETINGE AB-B SHS	25,755	181.250	4,668,093.750	
INVESTOR AB-A SHS	62,097	205.600	12,767,143.200	

LUNDBERGS B	7,859	441.400	3,468,962.600	
SKF AB-B SHS	46,594	183.800	8,563,977.200	
SANDVIK AB	150,884	203.600	30,719,982.400	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	119.850	26,648,407.800	
SKANSKA AB-B SHS	43,937	154.150	6,772,888.550	
SWEDBANK AB	130,971	181.550	23,777,785.050	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,465	140.200	12,963,593.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	184,499	89.260	16,468,380.740	
VOLVO AB-A SHS	24,198	224.200	5,425,191.600	
VOLVO AB-B SHS	209,640	218.600	45,827,304.000	
HOLMEN AB-B SHS	10,142	391.600	3,971,607.200	
TELE2 AB-B SHS	67,654	88.920	6,015,793.680	
INDUSTRIVARDEN A	15,292	288.100	4,405,625.200	
INDUSTRIVARDEN C	21,325	287.100	6,122,407.500	
SAAB AB-B	11,789	579.800	6,835,262.200	
SECURITAS AB-B SHS	76,085	86.640	6,592,004.400	
INVESTOR AB-B SHS	246,861	206.900	51,075,540.900	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	110,008	177.900	19,570,423.200	
ASSA ABLOY AB-B	140,043	250.800	35,122,784.400	
TELIA CO AB	344,810	23.980	8,268,543.800	
BOLIDEN AB	36,260	322.900	11,708,354.000	
ALFA LAVAL AB	44,259	372.400	16,482,051.600	
KINNEVIK AB-B	36,278	139.550	5,062,594.900	
FASTIGHETS AB BALDER	72,942	41.320	3,013,963.440	
INDUTRADE AB	39,178	230.400	9,026,611.200	
HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	95.080	4,541,876.520	
NIBE INDUSTRIER AB	212,832	97.620	20,776,659.840	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	204.200	3,753,196.000	
HEXAGON AB-B SHS	275,826	124.800	34,423,084.800	
SAGAX AB	28,022	212.400	5,951,872.800	
EPIROC AB-A	84,563	201.600	17,047,900.800	
EPIROC AB-B	61,487	172.900	10,631,102.300	
ESSITY AB-B	86,900	277.400	24,106,060.000	
EQT AB	55,194	203.800	11,248,537.200	
EMBRACER GROUP AB	79,791	23.885	1,905,808.030	
VOLVO CAR AB	63,710	45.130	2,875,232.300	
BEIJER REF AB	50,493	136.200	6,877,146.600	
LIFCO AB	26,835	214.000	5,742,690.000	
EVOLUTION AB	25,280	1,323.000	33,445,440.000	
NORDEA BANK ABP	457,613	115.440	52,826,844.720	
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	200.900	5,552,474.200	
スウェーデン・クローナ 小計	5,087,287		741,464,304.370 (9,757,670,246)	
デンマーク・ク ローネ				
CARLSBERG AS-B	14,635	1,034.000	15,132,590.000	
A P MOLLER A/S	663	12,515.000	8,297,445.000	

	AP MOLLER MAERSK A	520	12,340.000	6,416,800.000	
	DANSKE BANK A/S	101,212	164.300	16,629,131.600	
	GENMAB A/S	9,624	2,555.000	24,589,320.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	318.200	9,480,769.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,652.000	1,442,196.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	232,050	1,061.800	246,390,690.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	140,190	176.180	24,698,674.200	
	COLOPLAST-B	15,343	812.600	12,467,721.800	
	DSV A/S	26,166	1,420.500	37,168,803.000	
	DEMANT A/S	11,367	270.400	3,073,636.800	
	TRYG A/S	44,887	144.350	6,479,438.450	
	PANDORA A/S	12,473	627.200	7,823,065.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	475.800	5,965,580.400	
	ORSTED A/S	26,911	605.000	16,281,155.000	
デンマーク・クローネ 小計		679,247		442,337,016.850 (9,240,420,282)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.250	1,355,813.250	
	EBOS GROUP LTD	25,631	37.450	959,880.950	
	FISHER & PAYKEL	78,460	24.000	1,883,040.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.010	1,097,380.380	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.510	409,049.340	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.580	1,335,338.640	
ニュージーランド・ドル 小計		789,612		7,040,502.560 (619,353,010)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	168.850	9,518,918.750	
	NORSK HYDRO ASA	210,898	63.580	13,408,894.840	
	TELENOR ASA	85,954	106.950	9,192,780.300	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	466.400	5,216,684.000	
	ORKLA ASA	116,068	77.380	8,981,341.840	
	EQUINOR ASA	132,805	305.850	40,618,409.250	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	389.100	7,717,409.400	
	AKER BP ASA	50,741	265.100	13,451,439.100	
	SALMAR ASA	7,248	427.200	3,096,345.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	166.200	4,274,830.200	
	ADEVINTA ASA	24,382	66.200	1,614,088.400	
	DNB BANK ASA	139,232	197.700	27,526,166.400	
ノルウェー・クローネ 小計		880,443		144,617,308.080 (1,955,226,005)	
ユーロ	CRH PLC	102,020	49.100	5,009,182.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	25,007	177.350	4,434,991.450	
	KERRY GROUP PLC-A	20,761	87.860	1,824,061.460	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	57.340	1,253,452.400	
	UMICORE	34,853	25.550	890,494.150	
	AIR LIQUIDE	72,237	155.940	11,264,637.780	
	AIRBUS SE	83,511	132.040	11,026,792.440	

AXA SA	260,350	25.430	6,620,700.500
VEOLIA ENVIRONNEMENT	99,848	28.540	2,849,661.920
ADIDAS AG	22,590	167.340	3,780,210.600
ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	18.435	2,665,940.650
DASSAULT AVIATION SA	3,120	180.200	562,224.000
DANONE	88,043	55.080	4,849,408.440
SAFRAN SA	48,802	136.840	6,678,065.680
INTESA SANPAOLO	2,233,744	2.357	5,264,934.600
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45,234	107.480	4,861,750.320
ACCOR SA	20,392	33.520	683,539.840
BOUYGUES	29,123	29.260	852,138.980
BNP PARIBAS	157,769	55.350	8,732,514.150
THALES SA	15,023	131.550	1,976,275.650
CAPGEMINI SA	22,531	169.450	3,817,877.950
UNICREDIT SPA	266,042	21.295	5,665,364.390
D' IETEREN TRDG	2,736	156.300	427,636.800
COMMERZBANK AG	141,036	10.495	1,480,172.820
EIFFAGE	11,784	92.300	1,087,663.200
PRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	24.580	1,445,648.120
PUBLICIS GROUPE	33,221	70.500	2,342,080.500
IBERDROLA SA	805,663	11.130	8,967,029.190
ENI SPA	334,555	13.120	4,389,361.600
JERONIMO MARTINS	34,644	25.740	891,736.560
KESKO OYJ-B	35,252	17.465	615,676.180
KBC GROUPE	35,962	64.500	2,319,549.000
HANNOVER RUECK SE	8,405	186.500	1,567,532.500
WARTSILA OYJ	77,148	9.974	769,474.150
L' OREAL	33,329	405.950	13,529,907.550
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	38,691	830.900	32,148,351.900
GEA GROUP AG	24,987	36.690	916,773.030
BOLLORE	114,808	5.640	647,517.120
MEDIOBANCA SPA	86,792	11.015	956,013.880
MICHELIN (CGDE) -B	88,698	26.330	2,335,418.340
CONTINENTAL AG	17,450	67.640	1,180,318.000
DEUTSCHE POST AG-REG	136,158	43.980	5,988,228.840
OMV AG	17,258	39.850	687,731.300
VERBUND AG	10,663	70.650	753,340.950
PERNOD-RICARD	28,172	196.500	5,535,798.000
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	52.420	1,221,962.620
RENAULT SA	27,902	37.815	1,055,114.130
REPSOL SA	179,874	12.725	2,288,896.650
REMY COINTREAU	2,866	140.600	402,959.600
MERCK KGAA	18,389	145.850	2,682,035.650
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	69,513	54.280	3,773,165.640
RWE AG	85,480	38.610	3,300,382.800
SEB SA	2,596	94.750	245,971.000

SOCIETE GENERALE-A	104,069	23.245	2,419,083.900
VINCI S. A.	74,904	102.760	7,697,135.040
SODEXO	12,910	96.100	1,240,651.000
SOFINA	2,281	187.200	427,003.200
SOLVAY SA	9,070	101.750	922,872.500
SCHNEIDER ELECTRIC SE	76,154	158.180	12,046,039.720
VIVENDI SE	98,944	8.392	830,338.040
SAP SE	146,658	122.320	17,939,206.560
TELEFONICA S. A	750,387	3.621	2,717,151.320
TOTALENERGIES SE	331,567	51.230	16,986,177.410
VALEO	26,570	19.640	521,834.800
E. ON SE	308,720	11.215	3,462,294.800
VOEST-ALPINE AG	18,032	31.300	564,401.600
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	61.760	826,101.760
SIEMENS AG-REG	105,259	144.380	15,197,294.420
UPM-KYMMENE OYJ	77,752	27.660	2,150,620.320
ING GROEP NV-CVA	514,463	12.296	6,325,837.040
PUMA AG	17,998	52.340	942,015.320
BAYER AG	139,086	49.535	6,889,625.010
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	10.870	814,815.200
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	69.880	1,690,467.080
MERCEDES-BENZ GROUP AG	117,481	71.910	8,448,058.710
BASF SE	126,695	44.965	5,696,840.670
BEIERSDORF AG	12,940	116.600	1,508,804.000
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	68.560	1,479,936.160
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	25,398	43.190	1,096,939.620
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	379.750	2,525,717.250
ORANGE	280,606	10.376	2,911,567.850
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	39.880	2,555,510.400
RANDSTAD NV	15,584	49.160	766,109.440
ALLIANZ SE	56,860	205.850	11,704,631.000
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	433,193	4.326	1,873,992.910
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	135,085	31.235	4,219,379.970
HERMES INTL	4,325	1,876.600	8,116,295.000
ENDESA S. A.	50,946	19.290	982,748.340
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	9.100	658,312.200
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	31.650	1,445,961.900
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	20,074	326.900	6,562,190.600
ARCELOR MITTAL (NL)	64,774	23.930	1,550,041.820
DASSAULT SYSTEMES SA	92,308	39.205	3,618,935.140
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	25,380	29.610	751,501.800
RHEINMETALL STAMM	5,596	249.300	1,395,082.800
HEINEKEN NV	34,576	94.000	3,250,144.000
AKZO NOBEL	23,353	72.100	1,683,751.300
ASML HOLDING NV	56,393	645.200	36,384,763.600



AEGON NV	232,433	4.721	1,097,316.190
VOLKSWAGEN AG	3,315	152.550	505,703.250
VOLKSWAGEN AG PFD	28,721	122.040	3,505,110.840
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	835,535	6.878	5,746,809.730
KERING	10,209	480.750	4,907,976.750
ACCIONA S. A.	4,432	134.250	594,996.000
FORTUM OYJ	54,194	12.015	651,140.910
AGEAS	24,086	36.780	885,883.080
UCB SA	16,732	78.440	1,312,458.080
NEMETSCHEK SE	9,878	62.900	621,326.200
CARREFOUR SA	76,528	17.020	1,302,506.560
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	25.580	452,177.660
NOKIA OYJ	745,504	3.821	2,848,570.780
KONINKLIJKE PHILIPS NV	135,770	19.746	2,680,914.420
WOLTERS KLUWER-CVA	35,602	109.600	3,901,979.200
SANOFI	159,539	94.310	15,046,123.090
STMICROELECTRONICS NV	93,810	44.105	4,137,490.050
ELISA OYJ	20,242	47.140	954,207.880
BANCO SANTANDER SA	2,306,214	3.276	7,555,157.060
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	67,925	14.745	1,001,554.120
QIAGEN N. V.	34,306	40.960	1,405,173.760
DEUTSCHE BANK AG-REG	276,499	9.426	2,606,279.570
BMW VORZUG	7,821	99.850	780,926.850
ENEL SPA	1,145,862	6.076	6,962,257.510
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	458,973	19.480	8,940,794.040
SARTORIUS AG	3,651	307.300	1,121,952.300
INFINEON TECHNOLOGIES AG	186,083	36.280	6,751,091.240
RATIONAL AG	516	628.000	324,048.000
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	97.800	475,894.800
BECHTLE AG	14,521	36.390	528,419.190
KONINKLIJKE KPN NV	504,342	3.219	1,623,476.890
EUROFINS SCIENTIFIC	17,824	56.940	1,014,898.560
TELEPERFORMANCE	7,845	144.000	1,129,680.000
DEUTSCHE BOERSE AG	25,951	161.300	4,185,896.300
EURAZEO	5,673	60.600	343,783.800
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	69.940	903,484.920
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	78.450	1,387,780.500
INDITEX	150,465	34.310	5,162,454.150
ESSILORLUXOTTICA	41,410	171.000	7,081,110.000
SNAM SPA	256,415	4.581	1,174,637.110
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	10.602	1,769,696.440
ENAGAS	38,270	15.730	601,987.100
WENDEL	5,449	91.100	496,403.900
TENARIS SA	55,855	13.605	759,907.270
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.256	232,521.210
TERNA SPA	207,655	7.400	1,536,647.000
BIOMERIEUX	4,870	90.520	440,832.400

GRIFOLS SA	31,982	12.270	392,419.140
NESTE OYJ	56,226	35.270	1,983,091.020
RECORDATI SPA	17,680	42.320	748,217.600
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	87,314	12.670	1,106,268.380
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	227.600	1,660,114.400
KONE OYJ	49,300	46.350	2,285,055.000
ELIA GROUP	4,078	108.700	443,278.600
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	225.100	867,760.500
ENGIE	257,314	14.900	3,833,978.600
ALSTOM	47,494	25.640	1,217,746.160
IPSEN SA	3,873	108.700	420,995.100
ARKEMA SA	10,961	87.820	962,595.020
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	127.000	379,857.000
LEGRAND SA	38,836	88.400	3,433,102.400
AMPLIFON SPA	20,249	30.510	617,796.990
ADP	3,975	128.700	511,582.500
ORION OYJ	13,559	36.580	495,988.220
METSO CORPORATION	106,064	10.995	1,166,173.680
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.830	643,366.980
SYMRISE AG	17,265	93.440	1,613,241.600
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	31.040	1,006,378.880
PRYSMIAN SPA	31,596	36.700	1,159,573.200
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	91.560	222,399.240
CAIXABANK	565,553	3.689	2,086,325.010
BUREAU VERITAS SA	39,729	23.360	928,069.440
GETLINK	63,509	15.615	991,693.030
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	17.320	687,396.160
AMADEUS IT GROUP SA	62,816	66.120	4,153,393.920
BRENTAG SE	21,559	69.840	1,505,680.560
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	17.545	433,133.410
EDENRED	35,618	58.040	2,067,268.720
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	2.384	327,647.420
TALANX AG	11,451	51.400	588,581.400
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	52.680	432,450.120
VONOVIA SE	107,034	17.740	1,898,783.160
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	9.020	1,213,523.740
KNORR-BREMSE AG	10,342	64.880	670,988.960
OCI NV	12,329	22.900	282,334.100
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	49.710	1,975,326.270
FERRARI NV	17,998	289.500	5,210,421.000
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	13.160	1,892,960.720
AIB GROUP PLC	226,914	3.896	884,056.940
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	35.060	606,292.580
MONCLER SPA	29,763	62.660	1,864,949.580
NEXI SPA	83,576	7.530	629,327.280

PROSUS NV	113,220	64.120	7,259,666.400	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	111.200	1,687,348.800	
JDE PEET'S BV	14,385	26.680	383,791.800	
EXOR NV	14,142	80.160	1,133,622.720	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	15.120	1,132,367.040	
EURONEXT NV	14,089	61.350	864,360.150	
TMCD NV	8,848	129.500	1,145,816.000	
WORLDLINE SA	29,916	33.750	1,009,665.000	
NN GROUP NV	36,289	33.450	1,213,867.050	
FINECOBANK SPA	75,180	13.270	997,638.600	
ARGENX SE	7,482	351.600	2,630,671.200	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	114,291	20.740	2,370,395.340	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	64,874	31.880	2,068,183.120	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	27.620	271,283.640	
DSM-FIRMENICH AG	24,977	99.710	2,490,456.670	
ZALANDO SE	31,321	24.890	779,579.690	
STELLANTIS NV	309,373	16.266	5,032,261.210	
IBERDROLA SA-RTS	805,663	0.301	242,504.560	
FERROVIAL SE	75,279	28.840	2,171,046.360	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	25,380	1.473	37,384.740	
AENA SME SA	9,989	145.000	1,448,405.000	
CELLNEX TELECOM SAU	76,430	36.200	2,766,766.000	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	14.334	324,951.780	
ABN AMRO BANK NV	52,835	14.730	778,259.550	
SCOUT24 SE	10,048	55.100	553,644.800	
COVESTRO AG	27,558	47.500	1,309,005.000	
HELLOFRESH SE	17,856	24.270	433,365.120	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	123,927	50.680	6,280,620.360	
POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.782	576,052.190	
AMUNDI SA	12,553	53.950	677,234.350	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	11.630	487,052.770	
ADYEN NV	2,995	1,475.000	4,417,625.000	
DELIVERY HERO SE	22,564	39.380	888,570.320	
ユーロ 小計	25,646,749		649,132,332.210 (101,063,412,802)	
香港・ドル				
HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	11.580	2,976,060.000	
CLP HOLDINGS LTD	241,796	58.800	14,217,604.800	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	40.300	3,760,554.200	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	166,391	282.800	47,055,374.800	
MTR CORP	192,441	34.550	6,648,836.550	
HANG SENG BANK LTD	120,396	107.000	12,882,372.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	22.750	3,889,613.000	

POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	39.500	8,406,390.000	
HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	6.360	9,771,542.160	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	322,904	50.050	16,161,345.200	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	22.400	11,177,488.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	18.340	3,174,030.440	
SINO LAND CO	659,200	9.320	6,143,744.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	93.550	19,137,055.750	
SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	59.400	3,149,388.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	204,656	82.150	16,812,490.400	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	11.820	2,103,960.000	
AIA GROUP LTD	1,625,716	76.650	124,611,131.400	
HKT TRUST / HKT LTD	463,136	9.080	4,205,274.880	
SANDS CHINA LTD	335,800	27.400	9,200,920.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	14.880	2,083,200.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	18.760	3,782,016.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	38.450	9,848,390.750	
ESR GROUP LTD	216,400	12.760	2,761,264.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	18.620	4,934,300.000	
WH GROUP LTD	931,500	4.160	3,875,040.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	46.100	17,031,414.500	
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	42.200	11,233,429.000	
香港・ドル 小計	10,356,869		381,034,229.830 (6,885,288,533)	
合計	159,619,993		1,019,902,152,748 (1,019,902,152,748)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,277,474.310	
		GOODMAN GROUP	254,170.000	4,913,106.100	
		GPT GROUP	219,223.000	892,237.610	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	1,054,235.820	
		SCENTRE GROUP	852,352.000	2,224,638.720	
		STOCKLAND	369,843.000	1,453,482.990	
	VICINITY CENTRES	545,645.000	982,161.000		
	オーストラリア・ドル 小計		2,880,103.000	12,797,336.550 (1,210,883,985)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,479,994.280	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,176,610.260	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	763,301.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	648,800.000	
	シンガポール・ドル 小計		2,107,509.000	4,068,705.540 (428,394,006)	
投資信託受益証券 合計			4,987,612	1,639,277,991 (1,639,277,991)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,059.000	2,792,287.540	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,515,841.380	
		AMERICAN TOWER CORP	64,424.000	12,469,265.200	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,152,723.220	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,496.000	3,749,275.760	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,257.000	1,439,652.950	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	17,235.000	1,881,544.950	
		CROWN CASTLE INC	61,675.000	7,101,876.250	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	39,801.000	4,537,712.010	
		EQUINIX INC	12,944.000	10,140,976.800	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,301.000	1,469,412.890	
		EQUITY RESIDENTIAL	52,518.000	3,511,353.480	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,774.000	2,289,950.460	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	18,024.000	2,694,948.480	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,682,434.950	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,831.000	1,220,119.420	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68,971.000	1,420,112.890	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,632,712.830	
		INVITATION HOMES INC	86,531.000	3,006,952.250	
		IRON MOUNTAIN INC	39,185.000	2,302,902.450	
		KIMCO REALTY	79,991.000	1,583,021.890	
		MID AMERICA	17,377.000	2,664,936.720	
		PROLOGIS INC	129,684.000	15,796,808.040	
		PUBLIC STORAGE	22,068.000	6,419,801.880	
		REALTY INCOME CORP	93,882.000	5,569,080.240	
		REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,184,922.960	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	14,868.000	3,536,056.440	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	44,425.000	5,373,203.750	
		SUN COMMUNITIES INC	18,505.000	2,439,699.200	
		UDR INC	41,516.000	1,773,148.360	
		VENTAS INC	53,843.000	2,582,848.710	
		VICI PROPERTIES INC	140,502.000	4,430,028.060	
WELLTOWER INC	70,141.000	5,553,062.970			
WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,468,478.500			

	WP CAREY INC	27,925.000	1,890,522.500	
アメリカ・ドル	小計	1,730,123.000	132,277,676.380 (18,712,000,101)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	361,144.550	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,945.000	724,936.370	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,165,471.860	
イギリス・ポンド	小計	412,137.000	2,251,552.780 (409,872,668)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	437,844.400	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	275,354.160	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	713,198.560 (76,055,494)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	222,093.440	
	GECINA SA	9,166.000	868,020.200	
	KLEPIERRE	25,279.000	572,822.140	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,535.000	665,651.300	
	WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	529,033.960	
ユーロ	小計	73,192.000	2,857,621.040 (444,903,020)	
香港・ドル	LINK REIT	349,516.000	14,679,672.000	
香港・ドル	小計	349,516.000	14,679,672.000 (265,261,673)	
投資証券	合計	2,588,114	19,908,092,956 (19,908,092,956)	
合計			21,547,370,947 (21,547,370,947)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 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 606銘柄	71.58	—	—	74.35
	投資証券 35銘柄	—	—	1.77	
イギリス・ポンド	株式 79銘柄	4.16	—	—	4.26
	投資証券 3銘柄	—	—	0.04	
イスラエル・シェケル	株式 9銘柄	0.11	—	—	0.12
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	1.97	—	—	2.11
	投資信託受益証券 7銘柄	—	0.11	—	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.34	—	—	3.39
	投資証券 2銘柄	—	—	0.01	
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	0.31	—	—	0.36

	投資信託受益証券	4銘柄	—	0.04	—	
スイス・フラン	株式	44銘柄	2.88	—	—	2.92
スウェーデン・クローナ	株式	46銘柄	0.92	—	—	0.94
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.88	—	—	0.89
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.06	—	—	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.19	—	—	0.19
ユーロ	株式	223銘柄	9.57	—	—	9.75
	投資証券	5銘柄	—	—	0.04	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.65	—	—	0.69
	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7月11日現在

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



注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	10,360,306円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	200,458,192円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,734,475,997円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	229,234,136円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	66,729,093円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	28,512,812円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	17,581,635円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	4,049,282円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	4,335,517円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	18,037,372円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	20,856,033,836円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	459,606,640円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,104,568,599円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2（適格機関投資家限定）	294,926,167円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	6,637,919円
エマージング債券パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）	7,519,274円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	137,741,010円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	63,327,163円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,599,555,165円
計	60,615,089,140円
2. 受益権の総数	60,615,089,140口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその	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

差額	借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年7月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	△2,740,482,942	
合計	△2,740,482,942	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年4月19日から2023年7月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年7月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	718,000,000	—	715,556,819	2,443,181	
アメリカ・ドル	718,000,000	—	715,556,819	2,443,181	
合計	718,000,000	—	715,556,819	2,443,181	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT' L 1.625 06/02/28	5,000,000.000	4,326,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.7 03/02/31	5,000,000.000	4,094,985.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.875 09/15/31	6,000,000.000	4,917,372.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.125 09/30/24	10,000,000.000	9,589,300.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.5 04/16/25	10,000,000.000	9,508,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.5 09/30/29	9,000,000.000	7,978,941.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,376,620.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.125 04/16/30	9,000,000.000	8,231,940.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.125 09/30/49	9,000,000.000	6,444,738.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 3.875 04/16/50	10,000,000.000	8,232,750.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	13,000,000.000	12,343,357.390	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	7,000,000.000	5,973,259.880	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	13,000,000.000	11,415,993.420	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	9,000,000.000	8,448,217.830	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	15,000,000.000	10,927,074.450	
		BRAZIL 6.0 10/20/33	7,000,000.000	6,835,456.250	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,647,962.740	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,574,693.040	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	956,870.000	

COLOMBIA 3.0 01/30/30	6,000,000.000	4,637,441.760	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	9,000,000.000	6,749,805.960	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	9,000,000.000	6,569,620.560	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	5,000,000.000	2,934,821.250	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,000,000.000	5,698,093.980	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	8,000,000.000	6,941,782.960	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	9,000,000.000	6,146,614.170	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	9,000,000.000	8,689,265.190	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	7,000,000.000	7,018,369.680	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	6,000,000.000	5,247,829.980	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	7,000,000.000	5,947,413.570	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	17,000,000.000	15,939,664.270	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	17,000,000.000	13,148,188.960	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	11,200,000.000	10,323,699.230	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	4,000,000.000	3,401,839.920	
HUNGARY 2.125 09/22/31	14,000,000.000	10,719,632.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	14,000,000.000	8,608,418.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	10,000,000.000	9,654,610.000	
HUNGARY 5.375 03/25/24	5,380,000.000	5,363,526.440	
HUNGARY 6.125 05/22/28	10,000,000.000	10,054,130.000	
HUNGARY 6.25 09/22/32	11,000,000.000	11,079,200.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	4,200,000.000	3,327,796.330	
INDONESIA 3.05 03/12/51	9,000,000.000	6,419,935.350	
INDONESIA 3.4 09/18/29	2,200,000.000	2,013,065.010	
INDONESIA 3.5 01/11/28	4,200,000.000	3,925,348.180	
INDONESIA 3.85 10/15/30	11,400,000.000	10,587,896.140	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,163,665.260	
INDONESIA 4.2 10/15/50	8,000,000.000	6,699,735.280	
INDONESIA 4.35 01/08/27	3,600,000.000	3,521,102.540	
INDONESIA 4.75 01/08/26	2,000,000.000	1,985,162.880	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,500,000.000	3,079,365.500	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	9,000,000.000	8,796,600.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	14,000,000.000	13,852,552.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	6,000,000.000	6,024,660.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	11,000,000.000	8,313,495.190	
PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	6,939,678.720	
PANAMA 3.87 07/23/60	13,000,000.000	8,452,003.950	
PANAMA 4.5 01/19/63	6,000,000.000	4,323,739.800	
PANAMA 4.5 04/01/56	9,000,000.000	6,608,947.230	
PANAMA 6.4 02/14/35	10,000,000.000	10,290,078.800	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,039,892.260	

PERU 2.392 01/23/26	3,000,000.000	2,781,750.180	
PERU 2.78 12/01/60	9,000,000.000	5,360,167.440	
PERU 2.783 01/23/31	14,000,000.000	11,863,387.620	
PERU 3.0 01/15/34	12,000,000.000	9,828,823.200	
PERU 3.55 03/10/51	6,000,000.000	4,400,815.380	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	3,600,000.000	2,829,219.440	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	8,000,000.000	5,260,371.360	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	2,000,000.000	1,850,153.700	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	11,000,000.000	7,886,507.860	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	3,000,000.000	2,415,467.340	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	7,200,000.000	6,822,559.720	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	5,200,000.000	4,426,954.940	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	8,200,000.000	6,908,689.740	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	9,000,000.000	7,247,912.940	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	11,200,000.000	10,339,720.270	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	7,000,000.000	4,439,658.020	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	10,000,000.000	7,356,366.000	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	8,000,000.000	5,875,184.080	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	6,200,000.000	5,380,129.790	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,642,066.900	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	7,000,000.000	6,105,363.530	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	13,000,000.000	12,696,625.240	
ROMANIA 3.0 02/14/31	7,000,000.000	5,725,286.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	15,000,000.000	10,460,970.000	
ROMANIA 7.125 01/17/33	14,000,000.000	14,626,220.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	9,000,000.000	7,134,156.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	11,000,000.000	10,418,100.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	8,200,000.000	7,362,042.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	5,000,000.000	3,426,540.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	6,400,000.000	4,722,752.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	19,000,000.000	18,335,000.000	

SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,887,920.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	7,000,000.000	5,940,802.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	10,000,000.000	9,838,380.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	8,000,000.000	7,881,832.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	7,000,000.000	6,335,112.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	6,000,000.000	5,698,350.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	7,000,000.000	7,238,700.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	15,000,000.000	13,110,000.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	1,400,000.000	1,337,887.600	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	18,000,000.000	12,498,750.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	6,000,000.000	5,437,920.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	10,000,000.000	8,275,250.000	
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	6,000,000.000	5,900,400.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	13,000,000.000	12,564,500.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	10,000,000.000	9,492,010.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	11,000,000.000	10,628,145.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	14,000,000.000	12,446,000.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	16,000,000.000	15,136,000.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	3,000,000.000	2,934,900.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	5,000,000.000	3,509,500.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	4,000,000.000	3,875,860.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	10,000,000.000	8,240,455.300	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,301,989.280	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	7,000,000.000	5,783,208.060	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,575,888.800	
UNITED MEXICAN STATES	7,000,000.000	4,661,140.050	

	3.771 05/24/61			
	UNITED MEXICAN STATES	2,600,000.000	2,552,311.190	
	3.9 04/27/25			
	UNITED MEXICAN STATES	7,000,000.000	5,695,918.690	
	4.28 08/14/41			
	UNITED MEXICAN STATES	5,000,000.000	3,882,417.500	
	4.4 02/12/52			
	UNITED MEXICAN STATES	5,000,000.000	4,007,546.350	
	4.5 01/31/50			
	UNITED MEXICAN STATES	10,000,000.000	9,642,098.500	
	4.5 04/22/29			
	UNITED MEXICAN STATES	7,000,000.000	6,612,994.640	
	4.75 04/27/32			
	UNITED MEXICAN STATES	7,000,000.000	6,610,606.100	
	4.875 05/19/33			
	UNITED MEXICAN STATES	7,000,000.000	5,978,739.200	
	5.0 04/27/51			
	UNITED MEXICAN STATES	6,000,000.000	6,035,156.700	
	6.338 05/04/53			
	UNITED MEXICAN STATES	9,000,000.000	9,337,024.260	
	6.35 02/09/35			
	アメリカ・ドル 小計	1,026,080,000.000 (145,149,276,800)	881,876,893.210 (124,750,305,313)	
国債証券 合計		145,149,276,800 (145,149,276,800)	124,750,305,313 (124,750,305,313)	
合計			124,750,305,313 (124,750,305,313)	

(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 127銘柄	97.54	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7月11日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年1月12日
	至 2023年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	70,027,488,260円
同期中追加設定元本額	29,097,706,256円
同期中一部解約元本額	24,341,153,914円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	9,354,540,072円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	5,506,091,550円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,736,252円

MITO ラップ型ファンド (中立型)	11,898,926円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	31,631,937円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	38,187,188円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	31,533,423円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,349,017円
たわらノーロード 新興国株式	11,862,668,282円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,883,213,268円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,980,683,377円
たわらノーロード バランス (堅実型)	32,014,725円
たわらノーロード バランス (標準型)	128,208,811円
たわらノーロード バランス (積極型)	223,528,960円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	93,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	5,456,273円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	92,756,228円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	157,404,115円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	240,618,659円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	67,321円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,470,189円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,511,910円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	7,700,590円
たわらノーロード 全世界株式	513,167,284円
One DC 新興国株式インデックスファンド	932,369,429円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	373,154,066円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	401,972,605円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	596,408,352円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	1,084,327,239円
投資のソムリエ	18,986,012,564円
クルーズコントロール	670,209,941円
投資のソムリエ<DC年金>	1,548,359,206円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	458,074,216円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,593,097,762円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,073,570,161円
ワールドアセットバランス (基本コース)	561,734,015円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,453,969,412円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	67,938,528円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	33,653,211円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	11,499,822円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	221,888,617円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,261,415,786円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	327,850,156円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	72,050,608円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	36,741,899円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	22,906,890円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,297,935円
One グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	25,910,135円
エマージング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用)	10,390,617円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	519,386,127円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	7,498,046円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	197,751,409円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	91,070,400円
計	74,784,040,602円

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年7月11日現在 当期の

	損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	△1,228,947,989
投資信託受益証券	70,455,434
投資証券	△2,383,876
合計	△1,160,876,431

(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7月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

#### 通貨関連

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 株式関連

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

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	24,381	7.620	185,783.220	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,606	150.590	1,145,387.540	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,545	70.940	677,122.300	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	327,973	1.130	370,609.490	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	118,900	1.369	162,774.100	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	182,088	0.629	114,533.350	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	81,168	2.613	212,091.980	
	EFG HOLDING S. A. E. -GDR	50,259	0.805	40,458.490	
	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	37,340	15.890	593,332.600		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	46,195	6.320	291,952.400		

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	21,958	40.570	890,836.060		
JOYY INC-ADR	4,368	32.050	139,994.400		
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,996	39.460	236,602.160		
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000		
QIFU TECHNOLOGY INC ADR	12,687	18.630	236,358.810		
NIO INC ADR	155,618	10.780	1,677,562.040		
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	81,626	7.310	596,686.060		
AUTOHOME INC ADR	7,801	29.740	232,001.740		
MINISO GROUP HOLDING LTD ADR	11,832	17.760	210,136.320		
WEIBO CORP ADR	6,261	13.365	83,678.260		
KANZHUN LTD ADR	21,756	14.930	324,817.080		
KE HOLDINGS INC ADR	74,439	14.250	1,060,755.750		
LEGEND BIOTECH CORP ADR	6,123	71.050	435,039.150		
OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000		
LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	1.460	88,239.480		
PDD HOLDINGS INC ADR	56,296	70.140	3,948,601.440		
YUM CHINA HOLDINGS INC	46,864	56.360	2,641,255.040		
IQIYI INC ADR	53,811	5.120	275,512.320		
POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000		
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	47,853	25.100	1,201,110.300		
アメリカ・ドル 小計	307,915,864		18,073,231.880 (2,556,639,382)		
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	153,458	10.640	1,632,793.120	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	342,537	5.530	1,894,229.610	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	390,111	21.840	8,520,024.240	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	334,887	8.210	2,749,422.270	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	500,818	13.580	6,801,108.440	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	730,738	6.840	4,998,247.920	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	405,864	5.250	2,130,786.000	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	208,356	16.200	3,375,367.200	
	MULTIPLY GROUP	412,002	3.340	1,376,086.680	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	265,941	3.960	1,053,126.360	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	382,669	3.980	1,523,022.620	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		4,127,381		36,054,214.460 (1,390,971,594)	

インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	336,918	2,735.050	921,487,575.900	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	92,409	386.200	35,688,355.800	
	ASIAN PAINTS LTD	43,346	3,343.150	144,912,179.900	
	BANK OF BARODA	119,512	203.400	24,308,740.800	
	EICHER MOTORS LTD	15,971	3,173.900	50,690,356.900	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	30,972	1,743.000	53,984,196.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	103,526	1,551.400	160,610,236.400	
	SHREE CEMENT LTD	1,126	24,017.300	27,043,479.800	
	ICICI BANK LTD	570,586	948.400	541,143,762.400	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	59,693	298.000	17,788,514.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	192,937	592.600	114,334,466.200	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	28,293	671.650	19,002,993.450	
	TATA STEEL LTD	829,307	115.300	95,619,097.100	
	TATA MOTORS LTD	183,313	618.650	113,406,587.450	
	JSW STEEL LTD	67,054	810.600	54,353,972.400	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	65,145	825.650	53,786,969.250	
	BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,686	7,176.700	19,276,616.200	
	TATA POWER CO LTD	170,772	225.000	38,423,700.000	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	12,438	5,031.850	62,586,150.300	
	NESTLE INDIA LTD	3,821	22,580.250	86,279,135.250	
	GAIL INDIA LTD	246,273	108.950	26,831,443.350	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	121,205	1,866.900	226,277,614.500	
	VEDANTA LTD	74,877	282.250	21,134,033.250	
	AXIS BANK LTD	251,475	964.050	242,434,473.750	
	TITAN COMPANY LTD	38,975	3,045.550	118,700,311.250	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	366,114	162.750	59,585,053.500	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	13,391	1,779.350	23,827,275.850	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	428,992	123.000	52,766,016.000	
	LUPIN LTD	22,429	900.850	20,205,164.650	
	MPHASIS LTD	9,994	1,884.600	18,834,692.400	
	ACC LTD	7,500	1,794.700	13,460,250.000	
	BAJAJ FINANCE LTD	30,545	7,533.250	230,103,121.250	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	192,180	2,765.450	531,464,181.000	
	INFOSYS LTD	369,610	1,329.150	491,267,131.500	
	WIPRO LTD	160,261	389.950	62,493,776.950	
	TATA ELXSI LTD	4,214	7,487.250	31,551,271.500	
	MRF LTD	208	100,602.850	20,925,392.800	
	INDIAN OIL CORP LTD	302,373	97.400	29,451,130.200	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	90,425	2,656.550	240,218,533.750	
	TRENT LTD	21,899	1,676.650	36,716,958.350	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	10,567	5,158.350	54,508,284.450	



HCL TECHNOLOGIES LTD	107,656	1,124.500	121,059,172.000
DABUR INDIA LTD	65,862	572.700	37,719,167.400
HERO MOTOCORP LTD	11,725	3,123.700	36,625,382.500
SRF LTD	15,568	2,187.800	34,059,670.400
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,426	2,284.600	19,250,039.600
DR REDDYS LABORATORIES LTD	12,627	5,154.950	65,091,553.650
BHARTI AIRTEL LTD	246,520	885.400	218,268,808.000
UNITED SPIRITS LTD	31,096	914.900	28,449,730.400
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	108,651	1,045.000	113,540,295.000
DIVI'S LABORATORIES LTD	12,642	3,639.950	46,016,247.900
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,067	9,736.300	146,696,832.100
AUROBINDO PHARMA LTD	28,484	735.500	20,949,982.000
HAVELLS INDIA LTD	26,438	1,291.150	34,135,423.700
TVS MOTOR COMPANY LTD	25,167	1,309.250	32,949,894.750
INDRAPRASTHA GAS LTD	41,388	483.150	19,996,612.200
JINDAL STEEL & POWER LTD	44,846	626.350	28,089,292.100
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	255,944	90.800	23,239,715.200
SHRIRAM FINANCE LTD	23,798	1,723.200	41,008,713.600
PETRONET LNG LTD	84,155	228.550	19,233,625.250
CIPLA LTD/INDIA	61,350	1,016.700	62,374,545.000
LARSEN & TOUBRO LTD	75,700	2,438.750	184,613,375.000
ULTRATECH CEMENT LTD	12,645	8,351.350	105,602,820.750
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	101,064	3,271.950	330,676,354.800
ADANI ENTERPRISES LTD	18,069	2,410.250	43,550,807.250
NTPC LTD	493,770	191.550	94,581,643.500
YES BANK LTD	1,621,469	17.050	27,646,046.450
AMBUJA CEMENTS LTD	63,176	419.500	26,502,332.000
BHARAT FORGE LTD	26,609	851.250	22,650,911.250
HINDALCO INDUSTRIES LTD	143,115	427.850	61,231,752.750
ITC LTD	328,406	465.850	152,987,935.100
PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,138	2,595.850	47,083,527.300
UNITED PHOSPHORUS LTD	57,340	660.100	37,850,134.000
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,911	1,911.950	24,685,186.450
SIEMENS INDIA LTD	9,327	3,647.450	34,019,766.150
INFO EDGE INDIA LTD	7,593	4,331.850	32,891,737.050
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	65,008	388.650	25,265,359.200
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	42,939	1,054.850	45,294,204.150
TECH MAHINDRA LTD	62,258	1,147.150	71,419,264.700
INDIAN HOTELS CO LTD	90,065	384.850	34,661,515.250
MARICO LTD	63,240	527.100	33,333,804.000
PAGE INDUSTRIES LTD	764	36,384.500	27,797,758.000
ABB LTD/INDIA	5,625	4,369.650	24,579,281.250

	DLF LTD	64,955	501.550	32,578,180.250	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	399,666	250.000	99,916,500.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	55,683	720.100	40,097,328.300	
	BAJAJ FINSERV LTD	44,400	1,597.800	70,942,320.000	
	BAJAJ AUTO LTD	7,958	4,897.950	38,977,886.100	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	40,548	481.500	19,523,862.000	
	ADANI POWER LTD	77,437	242.050	18,743,625.850	
	MUTHOOT FINANCE LTD	15,852	1,255.350	19,899,808.200	
	COAL INDIA LTD	162,207	233.750	37,915,886.250	
	PI INDUSTRIES LTD	8,989	3,679.300	33,073,227.700	
	VARUN BEVERAGES LTD	47,922	812.250	38,924,644.500	
	TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	11,290	3,141.050	35,462,454.500	
	LTIMINDTREE LTD	9,351	4,997.750	46,733,960.250	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	33,577	959.450	32,215,452.650	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	112,166	668.250	74,954,929.500	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	763.750	12,066,486.250	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	8,797	3,776.450	33,221,430.650	
	BANDHAN BANK LTD	78,230	228.600	17,883,378.000	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,688	1,573.700	19,967,105.600	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	43,239	1,151.350	49,783,222.650	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	30,158	835.850	25,207,564.300	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	23,163	615.900	14,266,091.700	
	ZOMATO LTD	451,476	74.800	33,770,404.800	
	MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	91,363	612.650	55,973,541.950	
	SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	43,809	534.300	23,407,148.700	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	26,332	666.650	17,554,227.800	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	18,797	3,767.700	70,821,456.900	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	29,037	1,342.800	38,990,883.600	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	36,667	595.000	21,816,865.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	14,070	2,671.600	37,589,412.000	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	52,401	1,293.300	67,770,213.300	
インド・ルピー	小計	12,308,000		9,005,212,914.100 (15,488,966,212)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	902,200	1,980.000	1,786,356,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,885,085	755.000	2,178,239,175.000	

	UNITED TRACTORS TBK PT	190,201	24,100.000	4,583,844,100.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	476,900	7,250.000	3,457,525,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	822,500	4,250.000	3,495,625,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,323,600	6,775.000	15,742,390,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,642,200	3,950.000	22,286,690,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	923,900	5,375.000	4,965,962,500.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	292,400	8,975.000	2,624,290,000.000	
	BANK MANDIRI	4,188,100	5,175.000	21,673,417,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	7,477,000	5,400.000	40,375,800,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	784,000	9,050.000	7,095,200,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,270,600	2,000.000	4,541,200,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	375,332	6,425.000	2,411,508,100.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	6,098,000	9,050.000	55,186,900,000.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	287,700	6,300.000	1,812,510,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,841,700	2,420.000	4,456,914,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	259,300	11,325.000	2,936,572,500.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,697,900	2,710.000	4,601,309,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	2,218,600	1,105.000	2,451,553,000.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	97,130,800	108.000	10,490,126,400.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,232,482	3,350.000	4,128,814,700.000	
	インドネシア・ルピア 小計	140,320,500		223,282,746,975.000 (2,076,529,547)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	59.340	773,318.880	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	47.250	274,050.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	11.240	255,148.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	22.130	131,452.200	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	91.970	275,910.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	15,000	18.100	271,500.000	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	7,140	19.980	142,657.200	
	GUANGZHOU YUEXIU	48,300	6.450	311,535.000	

FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD				
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	9.170	110,040.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,080	62.160	750,892.800	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	12.760	155,672.000	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	15.270	267,225.000	
UNISPLENDOR CORP LTD	21,240	30.140	640,173.600	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	12.580	132,090.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	10.710	204,561.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	63.530	76,236.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	16.450	266,490.000	
HUAGONG TECH CO LTD	13,800	39.600	546,480.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	145.070	304,647.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	27.100	319,780.000	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	17.820	158,598.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	33.690	272,889.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	13,600	19.280	262,208.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	25.130	349,307.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	12.270	293,253.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	7.320	230,580.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	4.250	262,650.000	
GEM CO LTD	29,100	6.990	203,409.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	101.120	262,912.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	26.070	179,883.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	7.000	406,700.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	13.570	229,333.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	9,800	117.750	1,153,950.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO	15,593	7.800	121,625.400	

LTD				
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	25.050	147,895.200	
ZHEJIANG NHU CO LTD	27,312	15.380	420,058.560	
YUNNAN TIN CO LTD	28,000	15.890	444,920.000	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	8.730	258,408.000	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	24.890	332,530.400	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	19.470	128,502.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	24.590	125,409.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	46.630	433,659.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	27.570	286,728.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	11,500	35.990	413,885.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	33,300	42.000	1,398,600.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	16,950	44.100	747,495.000	
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	5,700	27.100	154,470.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	9.020	162,360.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	11.850	213,300.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	70.830	715,383.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	14.170	158,704.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	11.980	297,104.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.360	94,536.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	11.880	66,528.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	20.890	294,549.000	
DAAN GENE CO LTD	13,900	9.950	138,305.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	28.070	336,840.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	22.000	171,600.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	71,750	11.640	835,170.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	55.170	331,020.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	6,139	93.870	576,267.930	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO	11,470	45.270	519,246.900	

LTD				
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	11.410	144,907.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.930	144,231.000	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	32,000	8.750	280,000.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	60,929	18.530	1,129,014.370	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	30.160	325,728.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	3,584	35.800	128,307.200	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	11,100	32.810	364,191.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	21.850	150,765.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	87,100	6.550	570,505.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	49.650	243,285.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	10.140	155,142.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	17,900	44.070	788,853.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	25.340	126,700.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	99,100	3.030	300,273.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	30.380	483,042.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	23.880	234,024.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	9,400	213.000	2,002,200.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	9,800	66.070	647,486.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	6.870	102,706.500	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	27,875	31.240	870,815.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	12.890	112,658.600	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	9,682	13.230	128,092.860	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	38.360	349,076.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	164.910	593,676.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO	36,480	6.630	241,862.400	

LTD				
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	8.460	120,978.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	45,054	32.650	1,471,013.100	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	19.200	574,080.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.670	155,925.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	7.030	501,239.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	11.730	233,427.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	20.710	395,561.000	
IFLYTEK CO LTD	15,900	65.890	1,047,651.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.260	211,084.000	
GOERTEK INC	25,100	18.430	462,593.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.700	142,710.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	44,000	24.780	1,090,320.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	39,600	12.030	476,388.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	148,720	4.180	621,649.600	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.910	167,253.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	4.490	168,824.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	13.670	553,470.960	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.460	146,642.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	27,400	24.500	671,300.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	53.160	559,243.200	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	101,218	14.090	1,426,161.620	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	9,800	130.990	1,283,702.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	27,400	164.600	4,510,040.000	
WANDA FILM HOLDING CO LTD	21,700	14.060	305,102.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	66,200	7.350	486,570.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	4.210	918,201.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	12.520	574,668.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	18,700	36.670	685,729.000	

GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	8.910	376,893.000	
PING AN BANK CO LTD	153,100	11.200	1,714,720.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	44,580	18.390	819,826.200	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	146,300	4.690	686,147.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	13.910	766,441.000	
ZTE CORP	31,100	42.400	1,318,640.000	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.650	189,525.000	
WEICHAI POWER CO LTD	48,100	12.730	612,313.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	36.820	154,644.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	14.850	574,695.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	10.740	226,614.000	
BYD CO LTD	11,500	263.550	3,030,825.000	
YOUNGY CO LTD	2,100	66.480	139,608.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	6.850	206,870.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	6.580	224,378.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	41.660	402,435.600	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	49.700	259,434.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	16.600	182,600.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	44,500	11.950	531,775.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	18.000	151,200.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	43.060	90,426.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	24.480	235,008.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	20.690	242,073.000	
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	6,400	40.280	257,792.000	
RISEN ENERGY CO LTD	18,200	25.520	464,464.000	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU CO LTD	15,200	14.430	219,336.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	17.410	139,280.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	19.580	248,666.000	



NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,500	286.480	1,002,680.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	7.040	211,904.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	22.360	286,208.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.890	235,638.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	4.900	280,770.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	15.880	88,134.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	2,800	245.500	687,400.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	6.820	106,392.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	68.310	450,846.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	52.470	31,482.000	
NINESTAR CORP	17,000	34.930	593,810.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	9.640	245,048.800	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	21,400	16.320	349,248.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	51.800	82,880.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	13.640	230,516.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	24.950	266,965.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	120.490	219,291.800	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	92.330	166,194.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	6.980	105,398.000	
SF HOLDING CO LTD	32,000	46.430	1,485,760.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	52.880	95,184.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.720	134,992.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	50.170	200,680.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	89.470	223,675.000	
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	4,700	52.210	245,387.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	100,190	5.770	578,096.300	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	12.020	467,578.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO	73,000	5.870	428,510.000	

GROUP OF CHINA LTD				
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	75.850	174,455.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	24.310	634,491.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	16,161	39.150	632,703.150	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	13.530	123,123.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	49,400	14.610	721,734.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	61.800	191,580.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.020	225,450.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,446	27.240	339,029.040	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	7.600	294,880.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	31.490	116,513.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	6,760	17.870	120,801.200	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	14.870	227,183.860	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	130.620	287,364.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	34.400	151,704.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	9,300	94.330	877,269.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	63.850	172,395.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	33.930	105,183.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	90.890	190,869.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	44.800	408,396.800	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	13.760	130,720.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	5,400	143.600	775,440.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	15.150	156,045.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	4,700	72.000	338,400.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	33.570	231,633.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	76.800	348,672.000	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	163.820	491,460.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	33.950	91,665.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	8,030	22.600	181,478.000	

BGI GENOMICS CO LTD	1,300	60.440	78,572.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	30.980	148,704.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	32.450	100,595.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	26.070	83,424.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.390	93,853.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	9,100	72.120	656,292.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	12.390	263,907.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	13.200	174,240.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	4,200	85.670	359,814.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	75.800	144,020.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	36,700	8.250	302,775.000	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	24.940	294,292.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	23.800	1,335,180.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,400	293.180	2,169,532.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	60,800	4.770	290,016.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	8.380	129,890.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	109.510	175,216.000	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	4,050	58.330	236,236.500	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	16.950	144,075.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	31.780	129,026.800	
SG MICRO CORP	4,095	85.000	348,075.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	30,440	228.800	6,964,672.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	106.000	319,696.000	
WUXI APPTec CO LTD	19,572	63.600	1,244,779.200	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	36.900	380,070.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	92,100	3.630	334,323.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	4.110	339,075.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO	7,300	49.080	358,284.000	

LTD				
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	110.750	283,520.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	52,300	13.100	685,130.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	4,950	38.700	191,565.000	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	960	120.010	115,209.600	
BANK OF SUZHOU CO LTD	65,000	6.680	434,200.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	182.950	201,245.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	87.320	96,052.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,655	35.850	202,731.750	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	53.200	134,064.000	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	146.760	440,280.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	61.000	329,400.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	75,000	5.920	444,000.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	54.930	148,311.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	29.440	241,408.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	26,300	12.140	319,282.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	8,730	107.010	934,197.300	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	3,325	52.020	172,966.500	
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	3,220	40.530	130,506.600	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	16.990	217,472.000	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	43,700	7.650	334,305.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.610	298,323.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	4.120	291,284.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	24.240	259,368.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.170	202,616.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	108.270	238,194.000	

NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	47.690	138,301.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	268,400	5.540	1,486,936.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	72.590	232,288.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	228.800	183,040.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	163.800	251,596.800	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	185,000	4.890	904,650.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.610	222,810.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	38.800	89,240.000	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	900	109.300	98,370.000	
HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	596	371.540	221,437.840	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	4,000	70.280	281,120.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	6.220	270,570.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	5,070	35.050	177,703.500	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	108.480	151,872.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	40.250	245,525.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	26.610	42,576.000	
SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD	7,600	32.680	248,368.000	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	6,300	45.520	286,776.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	44.790	268,740.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	62.880	179,836.800	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	22,872	37.580	859,529.760	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.930	246,708.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	7,077	64.590	457,103.430	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING	2,900	60.990	176,871.000	

CO LTD				
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	5,320	29.290	155,822.800	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	148.570	386,282.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	17,100	36.220	619,362.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	43.100	198,260.000	
ASR MICROELECTRONICS CO LTD	4,000	76.590	306,360.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	13.120	527,424.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	196.960	551,488.000	
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP INC	5,600	49.650	278,040.000	
GALAXYCORE INC	18,400	15.800	290,720.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	51.760	210,145.600	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,600	448.000	716,800.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	5,200	133.860	696,072.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	3,247	446.000	1,448,162.000	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	21.080	400,520.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	600	335.660	201,396.000	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	40.390	347,354.000	
HUNAN CHANGYUAN LICO CO LTD	22,400	10.880	243,712.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.370	439,872.000	
WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	249,900	1.430	357,357.000	
PETROCHINA CO LTD	122,100	7.630	931,623.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	373,700	4.770	1,782,549.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	511,200	3.510	1,794,312.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	3.890	762,440.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	214,700	6.440	1,382,668.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	34.230	472,374.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	42,800	28.630	1,225,364.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	145,500	32.450	4,721,475.000	

PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	67,800	46.610	3,160,158.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	129,900	15.460	2,008,254.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	188,500	7.220	1,360,970.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	217,700	3.730	812,021.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.320	608,600.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	8,500	1,700.900	14,457,650.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	225,700	5.780	1,304,546.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	95,100	20.120	1,913,412.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,700	26.930	1,096,051.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.230	200,309.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	147,300	22.000	3,240,600.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.580	626,108.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	341,400	3.050	1,041,270.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	271,500	5.690	1,544,835.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	9.480	526,140.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.360	378,952.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	42,800	28.380	1,214,664.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	148,400	4.400	652,960.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	191,200	4.680	894,816.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	151,400	5.690	861,466.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	23.460	544,272.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	54,400	13.880	755,072.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	9.580	565,220.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	25.620	299,754.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	76,700	12.700	974,090.000	
CRRC CORP LTD	141,700	6.620	938,054.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	40,952	47.610	1,949,724.720	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	24.950	434,130.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	49,500	14.250	705,375.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	155,700	7.820	1,217,574.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE	16,300	39.230	639,449.000	

CO LTD				
HAIER SMART HOME CO LTD	53,700	23.130	1,242,081.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	16.630	801,566.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	3.790	383,927.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	6.220	349,564.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	17,400	30.880	537,312.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	6.890	181,896.000	
GEMDALE CORP	39,700	7.000	277,900.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	33,300	17.100	569,430.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	20,000	87.300	1,746,000.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.650	365,955.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	160,100	11.540	1,847,554.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	6.610	364,211.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	12.440	475,208.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	52,612	23.560	1,239,538.720	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	6.440	191,912.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	13,300	117.560	1,563,548.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	10.930	337,737.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.840	409,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	101.840	448,096.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.890	97,250.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	102,000	5.860	597,720.000	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD	19,300	14.850	286,605.000	
AIR CHINA LTD	60,700	8.720	529,304.000	
TBEA CO LTD	18,600	22.280	414,408.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	8.330	362,355.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	186,600	4.060	757,596.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	117,300	5.840	685,032.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	32,200	31.040	999,488.000	



SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	47.080	489,632.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	31.300	215,970.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	19.230	286,527.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.690	126,567.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	28,500	18.620	530,670.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	39,100	8.840	345,644.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	9.230	304,590.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	14.610	346,257.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	21.420	244,188.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	18,600	42.050	782,130.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	8.020	459,546.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,324	9.870	111,767.880	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	89,670	9.920	889,526.400	
CMOC GROUP LIMITED	119,700	5.470	654,759.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	48,300	10.640	513,912.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	6.310	213,278.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	52.390	471,510.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	23.980	482,477.600	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	27.850	217,230.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	11.200	310,240.000	
BBMG CORP	54,200	2.150	116,530.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	84,500	3.170	267,865.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.620	434,646.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	14,000	33.590	470,260.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	6.950	298,155.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	130,300	5.030	655,409.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	18.930	284,309.670	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	6.910	400,780.000	

SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	26,400	17.250	455,400.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	40.410	414,768.240	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	19.810	321,912.500	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD	127,500	2.490	317,475.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	19.120	63,096.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	117,700	6.470	761,519.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.720	160,480.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	35.670	363,834.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.420	178,038.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.440	164,864.000	
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO LTD	29,800	8.810	262,538.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	39.630	182,298.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	7.440	124,992.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	15,100	26.120	394,412.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	49,500	8.360	413,820.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	8.290	185,281.500	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.350	171,390.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.240	122,304.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	10.900	253,970.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,900	284.330	1,108,887.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	7.270	247,907.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,480	201.370	1,506,247.600	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	11.370	143,262.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.080	345,344.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	6.830	170,750.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	8,450	51.200	432,640.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	13.950	283,185.000	
CHINA NATIONAL MEDICINES	12,300	35.490	436,527.000	

CORP LTD				
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	7.750	150,350.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	3.060	89,352.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	14,400	25.200	362,880.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	11.000	350,900.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	15.300	192,780.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	13.780	359,658.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	37.070	155,694.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.550	268,460.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	10.000	474,600.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	17.450	221,615.000	
SHUANGLIANG ECO-ENERGY SYSTEMS CO LTD	32,200	13.210	425,362.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	18.480	107,738.400	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	14.870	289,965.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.550	148,090.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	12.860	288,064.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	22,500	14.810	333,225.000	
TONGWEI CO LTD	29,000	34.540	1,001,660.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	10,654	49.540	527,799.160	
JCET GROUP CO LTD	10,900	30.560	333,104.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	30.930	210,324.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	87.360	218,400.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	45.700	242,210.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	12.350	69,160.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	31.570	331,169.300	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	137.130	233,121.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	13.860	280,609.560	
SICHUAN HEBANG	62,400	2.420	151,008.000	

BIOTECHNOLOGY CO LTD				
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	15.050	198,660.000	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO LTD	89,400	4.830	431,802.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	9,624	63.960	615,551.040	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	8.210	160,916.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	14.360	281,456.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	11.470	225,959.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	13.580	213,206.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	87.870	149,379.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	35.880	175,812.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	23.210	129,976.000	
HAOHUA CHEMICAL SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	12,400	36.800	456,320.000	
SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	127.180	267,078.000	
BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	20.420	302,216.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	57.350	240,870.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,500	59.040	88,560.000	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	5,800	90.630	525,654.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	4,540	143.880	653,215.200	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	37.080	96,408.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	91.980	147,168.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	168.990	236,586.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	53.440	379,424.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	38.800	430,680.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	181,700	5.360	973,912.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	23.070	267,612.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	78,900	5.460	430,794.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	201.380	201,380.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	840	281.720	236,644.800	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	1,600	186.480	298,368.000	
3PEAK INC	1,200	231.160	277,392.000	
ZHEJIANG SUPCON	6,960	57.470	399,991.200	

TECHNOLOGY CO LTD				
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	46,968	29.690	1,394,479.920	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	12.430	157,861.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	129.800	233,640.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.240	384,092.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	27.550	281,010.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	63,251	19.190	1,213,786.690	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	28,819	46.030	1,326,538.570	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	13,400	52.580	704,572.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	32.800	229,600.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.150	107,580.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	72.800	509,600.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	22,300	17.270	385,121.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	14.470	588,929.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	7.370	773,850.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	50.480	171,632.000	
SERES GROUP CO LTD	11,700	44.220	517,374.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	61.330	325,049.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,800	66.660	186,648.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.250	603,200.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	45,400	11.700	531,180.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	22.570	257,298.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	51.230	71,722.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	20.170	40,340.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	28,300	15.390	435,537.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	8,850	38.550	341,167.500	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	11.700	355,680.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	55,200	7.140	394,128.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	103.790	332,128.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	21,300	19.430	413,859.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED	14,812	36.490	540,489.880	

	MATERIAL CO LTD				
	TOLY BREAD CO LTD	8,467	10.130	85,770.710	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,004	36.610	146,586.440	
	G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	500	444.460	222,230.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	57.190	168,138.600	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	17.470	197,585.700	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	9.950	490,535.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	63.070	416,262.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	16.340	261,440.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	42.670	192,015.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	103,500	2.790	288,765.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	14.010	149,907.000	
	オフショア・人民元 小計	17,731,878		257,840,044.510 (5,047,554,063)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	521,624	15.710	8,194,713.040	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	342,736	5.750	1,970,732.000	
	OOREDOO QSC	79,416	11.360	902,165.760	
	QATAR FUEL QSC	65,374	16.550	1,081,939.700	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	47,654	17.300	824,414.200	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	107,400	9.805	1,053,057.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	157,045	11.400	1,790,313.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	191,447	17.620	3,373,296.140	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	249,488	4.121	1,028,140.040	
	MASRAF AL RAYAN	673,411	2.504	1,686,221.140	
	BARWA REAL ESTATE CO	203,813	2.590	527,875.670	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	451,662	1.913	864,029.400	
	DUKHAN BANK	202,475	4.116	833,387.100	
	カタール・リアル 小計	3,293,545		24,130,284.190 (938,185,449)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	899,466	0.770	692,588.820	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	199,700	0.531	106,040.700	
	GULF BANK KSCP	210,518	0.270	56,839.860	

	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	848,871	0.960	814,916.160	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	171,911	0.634	108,991.570	
	MABANEE CO KPSC	72,704	0.872	63,397.880	
	BOUBYAN BANK KSCP	144,441	0.656	94,753.290	
クウェート・ディナール 小計		2,547,611		1,937,528.280 (894,518,056)	
コロンビア・ペ ソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	48,542	16,750.000	813,078,500.000	
	BANCOLOMBIA SA	27,434	30,870.000	846,887,580.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	45,692	27,790.000	1,269,780,680.000	
コロンビア・ペソ 小計		121,668		2,929,746,760.000 (99,690,493)	
サウジアラビ ア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	29,425	48.150	1,416,813.750	
	JARIR MARKETING CO	61,270	16.180	991,348.600	
	ETIHAD ETISALAT CO	44,779	46.650	2,088,940.350	
	SAUDI BRITISH BANK	114,739	38.850	4,457,610.150	
	AL RAJHI BANK	215,719	72.100	15,553,339.900	
	ARAB NATIONAL BANK	80,331	26.750	2,148,854.250	
	BANK ALBILAD	57,325	39.850	2,284,401.250	
	BANK AL-JAZIRA	41,743	18.420	768,906.060	
	BANQUE SAUDI FRANSI	68,778	41.550	2,857,725.900	
	RIYAD BANK	165,888	33.350	5,532,364.800	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,554	17.060	896,571.240	
	SAUDI TELECOM CO	221,787	44.750	9,924,968.250	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	26,822	131.200	3,519,046.400	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	99,482	88.800	8,834,001.600	
	SAUDI ELECTRICITY CO	87,717	22.900	2,008,719.300	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	38,856	25.500	990,828.000	
	SAVOLA GROUP	28,334	40.950	1,160,277.300	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	37,325	15.040	561,368.000	
	ALMARAI CO JSC	29,190	64.300	1,876,917.000	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,987	177.000	705,699.000	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,972	9.400	441,536.800	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	38,197	36.650	1,399,920.050	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	14,397	46.150	664,421.550	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	75,912	13.200	1,002,038.400		
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	65,392	15.880	1,038,424.960		
RABIGH REFINING &	47,684	11.260	536,921.840		

	PETROCHEMICAL CO				
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	59,190	13.800	816,822.000	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	7,946	187.600	1,490,669.600	
	ALINMA BANK	107,864	34.900	3,764,453.600	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	144,926	43.650	6,326,019.900	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,036	235.800	1,187,488.800	
	DALLAH HEALTHCARE CO	3,751	161.800	606,911.800	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	291,240	32.150	9,363,366.000	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	9,982	288.400	2,878,808.800	
	ACWA POWER CO	9,215	177.000	1,631,055.000	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	5,202	149.400	777,178.800	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,627	334.600	878,994.200	
	NAHDI MEDICAL CO	4,279	173.000	740,267.000	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	5,202	198.800	1,034,157.600	
	ELM CO	2,771	590.200	1,635,444.200	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	325,867	36.700	11,959,318.900	
	サウジアラビア・リアル 小計	2,779,703		118,752,920.900 (4,485,297,822)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	94,700	34.000	3,219,800.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	448,600	19.300	8,657,980.000	
	CP AXTRA PCL NVDR	222,800	33.500	7,463,800.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	124,300	35.250	4,381,575.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	57,000	130.500	7,438,500.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	864,300	8.800	7,605,840.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	29,400	130.000	3,822,000.000	
	SHIN CORP PCL	97,200	72.500	7,047,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	392,200	19.700	7,726,340.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	137,700	214.000	29,467,800.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	642,820	13.800	8,870,916.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	353,000	101.000	35,653,000.000	
	PTT PCL	1,112,000	34.000	37,808,000.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	116,200	46.750	5,432,350.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	826,100	8.350	6,897,935.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	90,250	324.000	29,241,000.000	



	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	474,200	70.750	33,549,650.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	241,900	65.750	15,904,925.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,283,200	27.750	35,608,800.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	62,800	219.000	13,753,200.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	328,110	33.250	10,909,657.500	
	THAI OIL PCL NVDR	124,700	45.250	5,642,675.000	
	CP ALL PCL NVDR	645,600	63.000	40,672,800.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	866,900	7.600	6,588,440.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	146,445	152.000	22,259,640.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	189,122	33.250	6,288,306.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	234,908	39.000	9,161,412.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	210,000	53.750	11,287,500.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	832,800	8.300	6,912,240.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	98,200	34.000	3,338,800.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	309,700	45.500	14,091,350.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	142,800	27.750	3,962,700.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	817,200	4.640	3,791,808.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	196,333	39.000	7,656,987.000	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	143,300	35.000	5,015,500.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	69,000	46.750	3,225,750.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	295,300	20.900	6,171,770.000	
	SCB X PCL NVDR	105,600	108.500	11,457,600.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,135,228	6.500	7,378,982.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	32,500	63.500	2,063,750.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	87,300	36.250	3,164,625.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	74,400	52.000	3,868,800.000	
	タイ・パーツ 小計	14,756,116		504,461,504.000 (2,038,024,476)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,062	666.000	5,369,292.000	
	CEZ	16,771	893.500	14,984,888.500	
	MONETA MONEY BANK AS	36,549	79.500	2,905,645.500	
チェコ・コルナ	小計	61,382		23,259,826.000 (151,979,703)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	7,247,805	37.750	273,604,638.750	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	6,442	23,095.000	148,777,990.000	

	BANCO DE CHILE	4,867,306	83.360	405,738,628.160	
	EMPRESAS CMPC SA	119,258	1,570.000	187,235,060.000	
	EMPRESAS COPEC SA	40,423	5,872.000	237,363,856.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	18,937	6,530.000	123,658,610.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,756,795	54.600	95,921,007.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,133,152	106.530	227,244,682.560	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	16,102	64,400.000	1,036,968,800.000	
	FALABELLA SA	101,069	2,045.000	206,686,105.000	
	CENCOSUD SA	155,959	1,646.000	256,708,514.000	
	ENEL CHILE SA	3,368,434	54.250	182,737,544.500	
	チリ・ペソ 小計	19,831,682		3,382,645,435.970 (588,248,807)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	336,662	20.500	6,901,571.000	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	73,827	61.600	4,547,743.200	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	154,226	39.400	6,076,504.400	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,410	825.200	6,114,732.000	
	HEKTAS TICARET TAS	121,118	32.240	3,904,844.320	
	KOC HOLDING AS	81,550	108.800	8,872,640.000	
	SASA POLYESTER SANAYI	108,067	58.950	6,370,549.650	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	144,586	46.820	6,769,516.520	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	14,011	254.500	3,565,799.500	
	TURK HAVA YOLLARI	58,741	214.600	12,605,818.600	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	133,611	40.100	5,357,801.100	
	TURKIYE IS BANKASI	457,413	13.990	6,399,207.870	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	118,510	90.550	10,731,080.500	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	313,727	12.990	4,075,313.730	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	133,924	47.100	6,307,820.400	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	48,633	185.400	9,016,558.200	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	78,429	28.460	2,232,089.340	
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	5,176	676.600	3,502,081.600		
	トルコ・リラ 小計	2,389,621		113,351,671.930 (614,751,458)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	17,072	8,350.000	142,551,200.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	47,806	3,004.000	143,609,224.000	
	OTP BANK NYRT	26,883	11,860.000	318,832,380.000	
	ハンガリー・フォリント 小計	91,761		604,992,804.000	

				(247, 553, 376)	
フィリピン・ペ ン	AYALA LAND INC	833, 700	24. 250	20, 217, 225. 000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	158, 120	54. 750	8, 657, 070. 000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	238, 588	108. 600	25, 910, 656. 800	
	AYALA CORP	33, 153	602. 000	19, 958, 106. 000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	108, 890	200. 400	21, 821, 556. 000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	338, 160	43. 650	14, 760, 684. 000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	46, 960	236. 000	11, 082, 560. 000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	206, 215	54. 000	11, 135, 610. 000	
	BDO UNIBANK INC	250, 632	135. 600	33, 985, 699. 200	
	PLDT INC	7, 725	1, 300. 000	10, 042, 500. 000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1, 070, 475	31. 900	34, 148, 152. 500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95, 620	137. 300	13, 128, 626. 000	
	SM INVESTMENTS CORP	27, 163	908. 000	24, 664, 004. 000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	31, 260	329. 000	10, 284, 540. 000	
	ACEN CORP	46, 119	5. 170	238, 435. 230	
フィリピン・ペン 小計	3, 492, 780		260, 035, 424. 730 (660, 463, 975)		
ブラジル・レア ル	VALE SA	378, 189	64. 460	24, 378, 062. 940	
	RAIA DROGASIL SA	144, 364	28. 480	4, 111, 486. 720	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23, 950	43. 700	1, 046, 615. 000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	139, 100	39. 280	5, 463, 848. 000	
	BANCO DO BRASIL SA	95, 400	49. 040	4, 678, 416. 000	
	ITAUSA SA	565, 126	9. 720	5, 493, 024. 720	
	GERDAU SA	129, 281	26. 290	3, 398, 797. 490	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	418, 610	33. 130	13, 868, 549. 300	
	VIBRA ENERGIA SA	139, 300	18. 220	2, 538, 046. 000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	523, 712	29. 550	15, 475, 689. 600	
	CCR SA	123, 220	13. 820	1, 702, 900. 400	
	WEG SA	187, 044	36. 290	6, 787, 826. 760	
	BANCO BRADESCO SA PREF	588, 802	16. 290	9, 591, 584. 580	
	BANCO BRADESCO SA	189, 692	14. 510	2, 752, 430. 920	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	64, 606	12. 300	794, 653. 800	
	SUZANO SA	89, 775	44. 030	3, 952, 793. 250	
	CPFL ENERGIA SA	23, 600	35. 670	841, 812. 000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	531, 847	28. 950	15, 396, 970. 650	
	ENGIE BRASIL SA	21, 587	44. 600	962, 780. 200	
	LOCALIZA RENT A CAR	100, 389	69. 730	7, 000, 124. 970	
LOJAS RENNER SA	104, 320	19. 100	1, 992, 512. 000		
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	77, 204	19. 410	1, 498, 529. 640		

	COSAN SA	130,100	18.870	2,454,987.000	
	TOTVS SA	53,400	30.020	1,603,068.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	114,500	32.690	3,743,005.000	
	JBS SA	84,600	17.570	1,486,422.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	163,762	12.540	2,053,575.480	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	35,998	56.000	2,015,888.000	
	ENEVA SA	95,700	12.340	1,180,938.000	
	HYPERA SA	47,100	45.040	2,121,384.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	658,248	14.080	9,268,131.840	
	MAGAZINE LUIZA SA	322,600	3.050	983,930.000	
	PRIO SA	85,600	39.490	3,380,344.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	50,728	41.930	2,127,025.040	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	72,900	31.180	2,273,022.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	556,961	4.320	2,406,071.520	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	73,200	11.520	843,264.000	
	AMBEV SA	514,995	15.010	7,730,074.950	
	NATURA &CO HOLDING SA	92,700	16.410	1,521,207.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	163,200	13.710	2,237,472.000	
	TIM SA	90,300	14.130	1,275,939.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	68,200	31.730	2,163,986.000	
	RUMO SA	147,200	22.200	3,267,840.000	
	ブラジル・リアル 小計	8,281,110		189,865,029.770 (5,481,080,639)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	407.300	547,411.200	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,937	112.050	1,673,690.850	
	BANK PEKAO SA	19,439	106.400	2,068,309.600	
	ORLEN SA	65,085	65.510	4,263,718.350	
	LPP SA	129	13,370.000	1,724,730.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,784	373.000	1,411,432.000	
	CD PROJEKT RED SA	7,001	145.500	1,018,645.500	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	101,321	36.730	3,721,520.330	
	CYFROWY POLSAT SA	31,925	16.130	514,950.250	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	120,449	7.052	849,406.340	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	63,307	38.240	2,420,859.680	
	DINO POLSKA SA	5,545	465.800	2,582,861.000	
	ALLEGRO. EU SA	56,048	31.950	1,790,733.600	
	PEPCO GROUP NV	16,587	35.800	593,814.600	
	ポーランド・ズロチ 小計	506,901		25,182,083.300	

				(882,984,569)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	165,200	3.600	594,720.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	733,000	5.190	3,804,270.000	
	CELCOMDIGI BHD	372,000	4.100	1,525,200.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	83,820	6.810	570,814.200	
	RHB BANK BHD	146,380	5.420	793,379.600	
	TOP GLOVE CORP BHD	500,700	0.850	425,595.000	
	GAMUDA BHD	207,900	4.350	904,365.000	
	GENTING BHD	209,800	4.090	858,082.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	35,456	17.300	613,388.800	
	HONG LEONG BANK BHD	65,508	18.820	1,232,860.560	
	IOI CORP BHD	276,013	3.770	1,040,569.010	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	53,100	22.700	1,205,370.000	
	MALAYAN BANKING BHD	582,175	8.670	5,047,457.250	
	MISC BHD	139,680	7.060	986,140.800	
	NESTLE MALAYSIA BHD	8,300	130.900	1,086,470.000	
	PPB GROUP BHD	82,160	15.900	1,306,344.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	34,400	21.960	755,424.000	
	PETRONAS GAS BHD	79,500	16.900	1,343,550.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	338,300	2.460	832,218.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	132,500	4.770	632,025.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	272,150	9.030	2,457,514.500	
	QL RESOURCES BHD	115,450	5.300	611,885.000	
	DIALOG GROUP BHD	458,444	2.200	1,008,576.800	
	PUBLIC BANK BHD (LOCAL)	1,606,850	3.860	6,202,441.000	
	SIME DARBY BERHAD	387,400	2.060	798,044.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	315,100	2.540	800,354.000	
MAXIS BHD	257,500	3.990	1,027,425.000		
INARI AMERTRON BHD	354,200	2.700	956,340.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	298,500	6.060	1,808,910.000		
IHH HEALTHCARE BHD	231,900	5.820	1,349,658.000		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	376,100	4.870	1,831,607.000		
SIME DARBY PLANTATION BHD	220,800	4.330	956,064.000		
MR DIY GROUP M BHD	403,200	1.500	604,800.000		
マレーシア・リンギット 小計	9,543,486		45,971,862.520 (1,394,542,658)		
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	346,100	10.130	3,505,993.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	149,500	87.610	13,097,695.000	
	GRUMA SAB DE CV	22,755	283.140	6,442,850.700	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,060	170.500	3,420,230.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	58,100	121.950	7,085,295.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	291,400	146.070	42,564,798.000	

	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	109,425	38.330	4,194,260.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	20,975	233.410	4,895,774.750	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	159,700	38.470	6,143,659.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	22,535	486.590	10,965,305.650	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	353,252	84.180	29,736,753.360	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	223,300	40.960	9,146,368.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	58,900	175.960	10,364,044.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	581,600	69.100	40,188,560.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	44,245	317.250	14,036,726.250	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	148,700	16.040	2,385,148.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,530,278	18.270	64,498,179.060	
	BANCO DEL BAJIO SA	82,800	52.340	4,333,752.000	
メキシコ・ペソ	小計	6,223,625		277,005,392.020 (2,298,092,133)	
ユーロ	ALPHA BANK A. E.	237,800	1.530	363,834.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	57,607	6.100	351,402.700	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,379	14.900	303,647.100	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	311,055	1.542	479,646.810	
	MYTILINEOS HOLDINGS	11,022	31.100	342,784.200	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	7,137	22.200	158,441.400	
	OPAP SA	22,309	15.780	352,036.020	
	JUMBO SA	12,011	26.500	318,291.500	
	PUBLIC POWER CORP	21,441	10.240	219,555.840	
	TERNA ENERGY SA	6,102	19.120	116,670.240	
ユーロ	小計	709,993		3,006,309.810 (468,052,374)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	100,100.000	172,172,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,285	111,600.000	478,206,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,633	232,500.000	844,672,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,937	75,900.000	374,718,300.000	
	COWAY CO LTD	5,833	42,900.000	250,235,700.000	
	KT&G CORP	12,031	81,600.000	981,729,600.000	
	CJ CORP	1,681	61,400.000	103,213,400.000	
	KAKAO CORP	35,333	49,850.000	1,761,350,050.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,228	6,900.000	215,473,200.000	

NCSOFT CORPORATION	1,509	281,000.000	424,029,000.000	
LG UPLUS CORP	24,033	10,150.000	243,934,950.000	
DOOSAN ENERBILITY	47,045	17,730.000	834,107,850.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	7,083	42,500.000	301,027,500.000	
LG H&H CO LTD	995	440,000.000	437,800,000.000	
LG CHEM LTD	5,559	654,000.000	3,635,586,000.000	
LG CHEM LTD	733	362,000.000	265,346,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	48,759	32,700.000	1,594,419,300.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	25,931	18,310.000	474,796,610.000	
S-OIL CORP	4,940	65,300.000	322,582,000.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	10,868	41,950.000	455,912,600.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,276	34,850.000	218,718,600.000	
POSCO FUTURE M CO LTD	3,492	408,000.000	1,424,736,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,282	151,000.000	344,582,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,438	75,400.000	259,225,200.000	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,383	121,700.000	533,411,100.000	
HYUNDAI MOBIS	6,915	232,500.000	1,607,737,500.000	
SK HYNIX INC	60,878	110,300.000	6,714,843,400.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	8,321	35,850.000	298,307,850.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,582	109,700.000	283,245,400.000	
HYUNDAI MOTOR CO	15,032	205,500.000	3,089,076,000.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,694	87,900.000	236,802,600.000	
HYUNDAI STEEL CO	9,520	33,700.000	320,824,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,033	10,180.000	285,375,940.000	
KIA CORPORATION	29,543	87,500.000	2,585,012,500.000	
KOREA ZINC CO LTD	817	451,500.000	368,875,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,465	19,480.000	535,018,200.000	
KOREAN AIR CO LTD	19,346	25,250.000	488,486,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,910	122,800.000	234,548,000.000	
KT CORP	7,359	29,100.000	214,146,900.000	
HLB INC	11,674	30,100.000	351,387,400.000	
LG ELECTRONICS INC	12,132	118,300.000	1,435,215,600.000	
LG CORP	10,962	84,800.000	929,577,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,290	9,440.000	144,337,600.000	
NAVER CORP	14,724	193,200.000	2,844,676,800.000	
L&F CO LTD	2,654	235,000.000	623,690,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,737	48,700.000	230,691,900.000	
KANGWON LAND INC	9,245	16,840.000	155,685,800.000	
POSCO HOLDINGS INC	8,051	397,000.000	3,196,247,000.000	

SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16,479	29,850.000	491,898,150.000	
COSMOAM&T CO LTD	2,720	195,300.000	531,216,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	6,133	685,000.000	4,201,105,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	6,561	138,600.000	909,354,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	529,691	69,500.000	36,813,524,500.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	65,848	7,200.000	474,105,600.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,750	131,800.000	494,250,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	90,561	57,700.000	5,225,369,700.000	
YUHAN CORP	5,839	56,600.000	330,487,400.000	
HANON SYSTEMS	19,141	9,070.000	173,608,870.000	
GS HOLDINGS CORP	6,510	36,050.000	234,685,500.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,742	14,570.000	345,920,940.000	
CELLTRION INC	12,478	148,300.000	1,850,487,400.000	
HANA FINANCIAL GROUP	34,089	37,950.000	1,293,677,550.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,928	195,500.000	376,924,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,764	68,900.000	121,539,600.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	9,610	70,500.000	677,505,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,032	95,000.000	288,040,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,430	163,100.000	1,048,733,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	890	266,500.000	237,185,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	31,293	4,760.000	148,954,680.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,436	290,000.000	416,440,000.000	
SK INC	4,394	143,100.000	628,781,400.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	43,772	46,750.000	2,046,341,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,426	53,500.000	397,291,000.000	
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,508	52,000.000	130,416,000.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	10,982	43,000.000	472,226,000.000	
HANMI PHARM CO LTD	927	276,500.000	256,315,500.000	
E-MART CO LTD	2,801	77,100.000	215,957,100.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,697	36,350.000	279,785,950.000	
HD HYUNDAI CO LTD	5,647	59,700.000	337,125,900.000	
BGF RETAIL CO LTD	715	170,500.000	121,907,500.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,527	120,600.000	304,756,200.000	
NETMARBLE CORP	2,597	44,200.000	114,787,400.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	58,047	11,390.000	661,155,330.000	
ECOPRO BM CO LTD	5,545	285,000.000	1,580,325,000.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	4,078	73,400.000	299,325,200.000	
KRAFTON INC	3,122	175,200.000	546,974,400.000	



	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,365	137,900.000	326,133,500.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,720	91,200.000	248,064,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	12,071	44,100.000	532,331,100.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	3,609	71,800.000	259,126,200.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	28,900.000	94,329,600.000	
	HYBE CO LTD	1,970	267,000.000	525,990,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,894	550,000.000	2,141,700,000.000	
	KAKAOBANK CORP	17,696	23,150.000	409,662,400.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,875	112,800.000	211,500,000.000	
	KAKAOPAY CORP	2,237	46,250.000	103,461,250.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	4,119	115,300.000	474,920,700.000	
	SAMSUNG C&T CORP	9,597	101,200.000	971,216,400.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,989	708,000.000	1,408,212,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	3,427	49,600.000	169,979,200.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	6,273	61,300.000	384,534,900.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	11,195	61,500.000	688,492,500.000	
	韓国・ウォン 小計	1,738,902		118,153,932,570.000 (12,902,409,437)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	119,000	11.840	1,408,960.000	
	JIANGSU EXPRESS	144,000	6.940	999,360.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	206,000	4.660	959,960.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	10,800	134.500	1,452,600.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	134,000	19.880	2,663,920.000	
	BEIJING ENTERPRISES	55,000	28.000	1,540,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	506,000	4.870	2,464,220.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	502,000	4.860	2,439,720.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	243,000	11.920	2,896,560.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	70,000	30.400	2,128,000.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	1,035,600	6.520	6,752,112.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	442,120	16.440	7,268,452.800	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	360,888	31.450	11,349,927.600	
	CITIC LTD	667,000	8.440	5,629,480.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	208,000	5.090	1,058,720.000	
	LENOVO GROUP LTD	842,000	8.450	7,114,900.000	
	PETRO CHINA CO LTD	2,394,000	5.380	12,879,720.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	163,390	7.760	1,267,906.400	
	SHANGHAI FUDAN	29,000	20.400	591,600.000	

MICROELECTRONIC				
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,781,200	4.420	12,292,904.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	102,000	13.580	1,385,160.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	297,000	10.660	3,166,020.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	90,900	90.250	8,203,725.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	416,000	5.860	2,437,760.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	4.510	685,520.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	194,200	8.400	1,631,280.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	152,000	10.540	1,602,080.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	380,000	3.430	1,303,400.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	201,000	6.910	1,388,910.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	291,200	8.410	2,448,992.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	74,500	21.750	1,620,375.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	698,000	9.600	6,700,800.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	99,000	25.250	2,499,750.000	
BYD CO LTD	110,000	256.800	28,248,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	200,000	8.600	1,720,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	411,592	3.070	1,263,587.440	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	300,000	4.930	1,479,000.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	13,000	113.100	1,470,300.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	797,788	8.420	6,717,374.960	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.820	836,580.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	225,200	17.820	4,013,064.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	283,500	9.290	2,633,715.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	843,000	12.040	10,149,720.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	593,000	11.440	6,783,920.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	264,400	10.480	2,770,912.000	
WEICHAI POWER CO LTD	231,440	11.360	2,629,158.400	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	8.490	967,860.000	
TINGYI HOLDING CORP	242,000	11.520	2,787,840.000	

TSINGTAO BREWERY CO LTD	72,000	69.100	4,975,200.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	320,000	6.600	2,112,000.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	316,000	3.440	1,087,040.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	185,333	48.450	8,979,383.850	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	184,000	5.970	1,098,480.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,100,250	3.430	3,773,857.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	360,000	27.350	9,846,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	690,700	328.800	227,102,160.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	707,000	48.650	34,395,550.000	
LI NING CO LTD	270,000	39.900	10,773,000.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	478,000	1.890	903,420.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	543,000	2.960	1,607,280.000	
AIR CHINA / HONG KONG	196,000	5.990	1,174,040.000	
ZTE CORP	83,888	29.650	2,487,279.200	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	381,500	23.600	9,003,400.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	326,250	7.770	2,534,962.500	
BANK OF COMMUNICATIONS	929,205	4.430	4,116,378.150	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	216,250	9.070	1,961,387.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	64,500	18.600	1,199,700.000	
BAIDU INC	251,200	137.700	34,590,240.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	10,681,530	4.380	46,785,101.400	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	95,600	76.500	7,313,400.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	376,000	3.630	1,364,880.000	
MINTH GROUP LTD	82,000	21.400	1,754,800.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	4.830	782,460.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	490,000	4.470	2,190,300.000	
BANK OF CHINA LTD	8,805,200	2.750	24,214,300.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	150,000	7.500	1,125,000.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	428,470	32.850	14,075,239.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,304,235	3.590	22,632,203.650	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	125,000	10.240	1,280,000.000	

KINGBOARD LAMINATES HOLDING	112,500	7.680	864,000.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	285,600	3.570	1,019,592.000	
CHINA COAL ENERGY CO	209,000	5.820	1,216,380.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	78,000	18.080	1,410,240.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	53,500	30.150	1,613,025.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	1,280,142	1.490	1,907,411.580	
CMOC GROUP LIMITED	384,000	4.320	1,658,880.000	
CHINA CITIC BANK-H	935,800	3.560	3,331,448.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	82,900	74.450	6,171,905.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	139,200	78.250	10,892,400.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	18.540	648,900.000	
FOSUN INTERNATIONAL	277,528	5.440	1,509,752.320	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	1.130	630,540.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	414,000	3.330	1,378,620.000	
KINGSOFT CORP LTD	115,400	31.200	3,600,480.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,162,000	1.640	3,545,680.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	481,000	5.150	2,477,150.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	152,000	6.340	963,680.000	
DONGYUE GROUP	159,000	6.250	993,750.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	83,500	25.000	2,087,500.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	513,000	5.180	2,657,340.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	307,000	19.980	6,133,860.000	
CRRC CORP LTD - H	465,000	4.220	1,962,300.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	159,000	7.580	1,205,220.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	143,000	11.920	1,704,560.000	
SINOPHARM GROUP CO	141,600	23.700	3,355,920.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	292,000	2.950	861,400.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	290,527	4.770	1,385,813.790	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	258,000	6.340	1,635,720.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	353,000	7.870	2,778,110.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	88,400	15.060	1,331,304.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY	211,000	13.560	2,861,160.000	

GROUP LTD				
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	151,000	10.180	1,537,180.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	200,500	16.960	3,400,480.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	88,300	19.300	1,704,190.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	2.860	1,796,526.160	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	106,000	4.970	526,820.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.180	494,860.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	3,217,000	2.610	8,396,370.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	78,000	29.450	2,297,100.000	
FAR EAST HORIZON LTD	120,000	5.840	700,800.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	90,800	13.740	1,247,592.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	196,500	13.620	2,676,330.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	363,600	4.830	1,756,188.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	1,050,000	2.780	2,919,000.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	20.650	949,900.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	348,000	4.090	1,423,320.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	176,000	3.720	654,720.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	831,000	4.360	3,623,160.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	57,000	16.380	933,660.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	144,000	16.400	2,361,600.000	
EAST BUY HOLDING LTD	42,500	28.700	1,219,750.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	233,000	9.420	2,194,860.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,100	18.420	1,033,362.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	83,750	14.580	1,221,075.000	
CHINA TOWER CORP LTD	4,690,000	0.870	4,080,300.000	
XIAOMI CORP	1,709,400	10.660	18,222,204.000	

BEIGENE LTD	78,600	114.400	8,991,840.000	
WUXI APPTEC CO LTD	41,512	62.750	2,604,878.000	
MEITUAN	563,110	121.100	68,192,621.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	128,000	16.680	2,135,040.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	176,000	16.800	2,956,800.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	574,000	8.450	4,850,300.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	121,000	29.750	3,599,750.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	997,000	0.780	777,660.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	104,000	10.380	1,079,520.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	143,500	9.170	1,315,895.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	205,000	6.410	1,314,050.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	128,000	12.660	1,620,480.000	
CHINA FEIHE LTD	374,000	4.430	1,656,820.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,837,168	87.000	159,833,616.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	19,300	24.300	468,990.000	
JD.COM INC	261,935	137.000	35,885,095.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	184,000	7.570	1,392,880.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	110.500	839,800.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	84,000	12.620	1,060,080.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	262,700	54.100	14,212,070.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	261,200	24.000	6,268,800.000	
BILIBILI INC	19,420	114.500	2,223,590.000	
AKESO INC	49,000	35.650	1,746,850.000	
NETEASE INC	219,600	150.500	33,049,800.000	
GDS HOLDINGS LTD	90,500	10.180	921,290.000	
ZAI LAB LTD	98,700	22.300	2,201,010.000	
NONGFU SPRING CO LTD	199,200	42.350	8,436,120.000	
LI AUTO INC	125,400	137.400	17,229,960.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	128,600	51.250	6,590,750.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	37,200	44.200	1,644,240.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	83,600	37.200	3,109,920.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12,600	44.200	556,920.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	241,661	10.100	2,440,776.100	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	176,200	32.900	5,796,980.000	

	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	49,600	17.120	849,152.000	
	JD LOGISTICS INC	210,400	11.940	2,512,176.000	
	TRIP.COM GROUP LTD	61,750	267.600	16,524,300.000	
	XPENG INC	118,700	53.400	6,338,580.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	64,000	26.650	1,705,600.000	
	CGN POWER CO LTD	1,043,000	1.930	2,012,990.000	
	GF SECURITIES CO LTD	106,000	10.680	1,132,080.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	61,600	32.000	1,971,200.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	115,800	9.600	1,111,680.000	
	3SBIO INC	198,500	7.180	1,425,230.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	164,000	6.230	1,021,720.000	
	CHINA LITERATURE LTD	38,600	30.600	1,181,160.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	43,000	25.050	1,077,150.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	261,500	3.480	910,020.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	145,000	8.030	1,164,350.000	
	BOC AVIATION LTD	23,600	63.100	1,489,160.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	77,600	21.900	1,699,440.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	16.680	2,068,320.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	178,800	13.840	2,474,592.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	429,000	38.000	16,302,000.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	648,000	2.000	1,296,000.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	47,440	51.050	2,421,812.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	18.640	1,118,400.000	
	香港・ドル 小計	94,049,228		1,301,919,961.800 (23,525,693,710)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	58,878	357.500	21,048,885.000	
	ACER INC	310,577	32.200	10,000,579.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	82,121	292.000	23,979,332.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	54,256	379.000	20,563,024.000	
	ASIA CEMENT CORP	236,105	43.850	10,353,204.250	
	TAIWAN BUSINESS BANK	645,437	14.150	9,132,933.550	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	113,504	80.000	9,080,320.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	71,660	175.500	12,576,330.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	155,325	167.000	25,939,275.000	
	QUANTA COMPUTER INC	302,902	162.500	49,221,575.000	

EVA AIRWAYS CORP	313,028	39.700	12,427,211.600	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	78,161	171.500	13,404,611.500	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	548,588	18.350	10,066,589.800	
CHINA AIRLINES	290,000	26.000	7,540,000.000	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	207,138	39.450	8,171,594.100	
CHINA STEEL CORP	1,334,645	28.700	38,304,311.500	
ADVANTECH CO LTD	54,923	370.500	20,348,971.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	449,676	28.700	12,905,701.200	
DELTA ELECTRONICS INC	214,888	348.500	74,888,468.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	154,378	69.700	10,760,146.600	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	413,432	114.000	47,131,248.000	
AUO CORP	699,622	18.600	13,012,969.200	
TAIWAN MOBILE CO LTD	179,951	93.500	16,825,418.500	
EVERGREEN MARINE CORP	106,579	104.500	11,137,505.500	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	301,339	32.000	9,642,848.000	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	44,768	191.000	8,550,688.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	19,322	489.000	9,448,458.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	66,265	430.500	28,527,082.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	426,464	82.300	35,097,987.200	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	405,993	63.600	25,821,154.800	
GIANT MANUFACTURING	31,244	231.000	7,217,364.000	
MEDIATEK INC	169,351	673.000	113,973,223.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	817,592	60.200	49,219,038.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	998,092	21.400	21,359,168.800	
HOTAI MOTOR CO LTD	33,447	777.000	25,988,319.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	192,532	69.600	13,400,227.200	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,136,633	23.000	26,142,559.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,065,936	42.650	45,462,170.400	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,693,947	12.200	20,666,153.400	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,511,818	25.450	38,475,768.100	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,375,350	104.500	143,724,075.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,229,286	36.850	45,299,189.100	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,566	2,345.000	24,777,270.000	
TAISHIN FINANCIAL	1,209,338	18.350	22,191,352.300	



HOLDINGS CO LTD				
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,422,291	8.710	12,388,154.610	
INVENTEC CO LTD	325,410	44.400	14,448,204.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	231,972	112.000	25,980,864.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,192,206	17.350	20,684,774.100	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,961,802	24.500	48,064,149.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,165,059	27.300	31,806,110.700	
NAN YA PLASTICS CORP	530,076	69.000	36,575,244.000	
WISTRON CORP	299,866	103.000	30,886,198.000	
POU CHEN CORP	233,990	30.850	7,218,591.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	525,066	73.700	38,697,364.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	66,771	287.500	19,196,662.500	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	138,515	79.200	10,970,388.000	
E INK HOLDINGS INC	97,790	212.000	20,731,480.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	174,336	35.850	6,249,945.600	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	148,123	55.900	8,280,075.700	
TAIWAN CEMENT CORP	675,833	36.850	24,904,446.050	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,733,842	565.000	1,544,620,730.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,263,129	48.100	60,756,504.900	
WAN HAI LINES LTD	78,747	53.600	4,220,839.200	
WALSIN LIHWA CORP	270,176	41.150	11,117,742.400	
WINBOND ELECTRONICS CORP	323,927	26.700	8,648,850.900	
YAGEO CORP	33,192	485.000	16,098,120.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	210,857	48.850	10,300,364.450	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	193,000	31.200	6,021,600.000	
GLOBAL UNICHIP CORP	9,374	1,615.000	15,139,010.000	
INNOLUX CORPORATION	1,084,496	15.500	16,809,688.000	
WPG HOLDINGS CO LTD	165,203	56.300	9,300,928.900	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	24,219	243.500	5,897,326.500	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	7,064	2,095.000	14,799,080.000	
PEGATRON CORP	210,159	69.900	14,690,114.100	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,712	990.000	14,564,880.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	44,828	167.000	7,486,276.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	171,918	201.500	34,641,477.000	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	999.000	7,992,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY	84,757	105.000	8,899,485.000	

	HOLDING LTD				
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	1,085,917	27.850	30,242,788.450	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	447,563	43.350	19,401,856.050	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	6,993	1,850.000	12,937,050.000	
	WIWYNN CORP	9,239	1,545.000	14,274,255.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	342,552	108.000	36,995,616.000	
	SILERGY CORP	34,423	362.000	12,461,126.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	325,413	30.000	9,762,390.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	25,128	346.000	8,694,288.000	
	MOMO.COM INC	8,206	698.000	5,727,788.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	23,344	490.000	11,438,560.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	18,912	335.000	6,335,520.000	
	台湾・ドル 小計	38,263,453		3,541,163,208.210 (15,960,730,812)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	16,067	187.130	3,006,617.710	
	BIDVEST GROUP LTD	32,641	259.870	8,482,416.670	
	CLICKS GROUP LTD	29,788	254.560	7,582,833.280	
	DISCOVERY LTD	57,120	145.000	8,282,400.000	
	GOLD FIELDS LTD	101,931	249.470	25,428,726.570	
	REMGRO LTD	63,511	150.400	9,552,054.400	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,991	93.700	3,091,256.700	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	55,410	74.850	4,147,438.500	
	EXXARO RESOURCES LTD	24,734	162.220	4,012,349.480	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	10,123	1,534.370	15,532,427.510	
	MTN GROUP LTD	191,381	132.150	25,290,999.150	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	48,349	375.000	18,130,875.000	
	FIRSTRAND LTD	555,207	67.470	37,459,816.290	
	NASPERS LTD	21,670	3,219.840	69,773,932.800	
	NEDBANK GROUP LTD	48,638	221.770	10,786,449.260	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	7,041	810.420	5,706,167.220	
	SASOL LTD	66,054	238.150	15,730,760.100	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	53,051	220.870	11,717,374.370	
	MR PRICE GROUP LTD	26,025	145.230	3,779,610.750	
	STANDARD BANK GROUP LTD	148,427	175.680	26,075,655.360	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	115,381	73.400	8,468,965.400	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	38,563	178.070	6,866,913.410	
	ABSA GROUP LTD	90,120	168.480	15,183,417.600	
	SANLAM LTD	189,142	59.900	11,329,605.800	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS	89,896	118.210	10,626,606.160	

LTD				
KUMBA IRON ORE LTD	6,921	423.770	2,932,912.170	
OUTSURANCE GROUP LTD	92,899	35.120	3,262,612.880	
VODACOM GROUP PTY LTD	66,961	114.230	7,648,955.030	
NEPI ROCKCASTLE NV	50,449	108.240	5,460,599.760	
OLD MUTUAL LTD	599,143	12.000	7,189,716.000	
REINET INVESTMENTS SCA	14,603	411.800	6,013,515.400	
PEPKOR HOLDINGS LTD	240,457	16.310	3,921,853.670	
MULTICHOICE GROUP LTD	34,585	86.500	2,991,602.500	
SIBANYE STILLWATER LTD	338,208	28.800	9,740,390.400	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	38,211	117.840	4,502,784.240	
BID CORP LTD	37,126	417.050	15,483,398.300	
南アフリカ・ランド 小計	3,632,824		435,194,009.840 (3,272,658,954)	
合計	694,719,014		103,465,619,699 (103,465,619,699)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	132,600.000	4,190,160.000		
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	38,000.000	1,129,740.000		
		ENERGISA SA	23,500.000	1,194,740.000		
		KLABIN SA	78,200.000	1,696,158.000		
	ブラジル・レアル 小計			272,300.000	8,210,798.000 (237,031,780)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,679,475.000	19,649,857.500		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	54,100.000	7,490,686.000		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	213,700.000	39,771,707.000		
		GRUPO TELEVISIA SAB	316,200.000	5,280,540.000		
	メキシコ・ペソ 小計			2,263,475.000	72,192,790.500 (598,925,829)	
	投資信託受益証券 合計			2,535,775	835,957,609 (835,957,609)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	306,900.000	7,669,431.000		
	メキシコ・ペソ 小計		306,900.000	7,669,431.000 (63,627,134)		
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	441,090.000	5,112,233.100		
	南アフリカ・ランド 小計		441,090.000	5,112,233.100 (38,443,993)		
投資証券 合計			747,990	102,071,127 (102,071,127)		
合計				938,028,736 (938,028,736)		

(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 48銘柄	2.31	—	—	2.45
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.26	—	—	1.33
インド・ルピー	株式 114銘柄	13.99	—	—	14.84
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.88	—	—	1.99
オフショア・人民元	株式 516銘柄	4.56	—	—	4.83
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.85	—	—	0.90
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.81	—	—	0.86
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 41銘柄	4.05	—	—	4.30
タイ・バーツ	株式 42銘柄	1.84	—	—	1.95
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.14	—	—	0.15
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.53	—	—	0.56
トルコ・リラ	株式 18銘柄	0.56	—	—	0.59
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.22	—	—	0.24
フィリピン・ペソ	株式 15銘柄	0.60	—	—	0.63
ブラジル・レアル	株式 43銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	4.95 —	— 0.21	— —	5.48
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.80	—	—	0.85
マレーシア・リンギット	株式 33銘柄	1.26	—	—	1.34
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	2.08 — —	— 0.54 —	— — 0.06	2.84
ユーロ	株式 11銘柄	0.42	—	—	0.45
韓国・ウォン	株式 102銘柄	11.65	—	—	12.36
香港・ドル	株式 195銘柄	21.24	—	—	22.53
台湾・ドル	株式 90銘柄	14.41	—	—	15.29
南アフリカ・ランド	株式 36銘柄 投資証券 1銘柄	2.96 —	— —	— 0.03	3.17

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

D I A Mマネーマザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	186,971,516
国債証券	300,187,000
未収利息	3,146
前払費用	424
流動資産合計	487,162,086
資産合計	487,162,086
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	—
負債合計	—
純資産の部	
元本等	
元本	484,219,525
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	2,942,561
元本等合計	487,162,086
純資産合計	487,162,086
負債純資産合計	487,162,086

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年7月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1, 178, 259, 939円
同期中追加設定元本額	69, 213, 396円
同期中一部解約元本額	763, 253, 810円
元本の内訳	
ファンド名	
バンクローン・ファンド（ヘッジなし）	15, 843, 407円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）	13, 867, 169円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし／年1回決算型）	1, 088, 285円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり／年1回決算型）	98, 095円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	3, 959, 763円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号	989, 197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号	494, 102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号	494, 102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号	48, 517円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	395, 083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号	11, 377円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号	98, 027円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号	989, 197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号	395, 083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号	494, 102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号	494, 102円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり>	791, 316円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし>	2, 474, 972円
クルーズコントロール	294, 245, 101円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870, 000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530, 000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70, 000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>	10, 530, 000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149, 716円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5, 972円
USストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジあり）	993, 740円
USストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	1, 987, 479円
D I A M-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>	9, 935円
マッシュューズ・アジア株式ファンド	29, 641, 137円

One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円
One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円
One世界分散セレクト (Cコース)	99,040円
世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型)	99,109円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり)	188,380円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし)	109,063円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり)	297,442円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし)	118,977円
ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジあり)	301,134円
PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジなし)	1,493,740円
計	484,219,525円
2. 受益権の総数	484,219,525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 2023年1月12日 至 2023年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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7月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	
国債証券		△87,000
合計		△87,000

(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6日から2023年7月11日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0061円 (10,061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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	429回 利付国庫債券 (2年)	100,000,000	100,037,000	
	430回 利付国庫債券 (2年)	100,000,000	100,046,000	
	435回 利付国庫債券 (2年)	100,000,000	100,104,000	
国債証券 合計		300,000,000	300,187,000	
合計			300,187,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2023年7月31日現在

I 資産総額	10,275,244,126円
II 負債総額	15,651,818円
III 純資産総額 (I - II)	10,259,592,308円
IV 発行済数量	8,070,145,799口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2713円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

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

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

2023年7月31日現在

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年7月31日現在

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年7月31日現在

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

D I A Mマネーマザーファンド

2023年7月31日現在

I 資産総額	487,105,557円
II 負債総額	0円
III 純資産総額 (I - II)	487,105,557円
IV 発行済数量	484,219,525口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.0060円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2023年7月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2023年7月31日現在）

###### ① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### ② 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

###### 2. 運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書

を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,552,827,736,355
追加型株式投資信託	783	15,353,432,764,987
単位型公社債投資信託	22	38,793,354,246
単位型株式投資信託	208	1,109,369,905,668
合計	1,039	18,054,423,761,256

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。



# 独立監査人の監査報告書

2023年5月25日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	31,421	33,770
金銭の信託	30,332	29,184
未収委託者報酬	17,567	16,279
未収運用受託報酬	4,348	3,307
未収投資助言報酬	309	283
未収収益	5	15
前払費用	1,167	1,129
その他	2,673	2,377
流動資産計	87,826	86,346
固定資産		
有形固定資産		
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		
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		
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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	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		その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	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 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			△12,360
当期純利益			13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	1,461
当期末残高	△0	△0	79,034



## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投

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

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過の取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、(金融商品会計)注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載していません。

## 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。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

# 約 款

追加型証券投資信託  
クルーズコントロール  
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の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、「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、「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目指す上場している投資信託証券（ETF）、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

(2) 投資態度

①以下のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式、公社債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
- ・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
- ・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

（上記それぞれおよびDIAMマネーマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

- ・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果を目指す上場している投資信託証券（ETF）、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。
- ・実質的な組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。

②各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。

- ・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、投資比率の見直しを行うことがあります。

③基準価額の下落を一定水準（下値目安値<sup>(\*)</sup>）までに抑えることを目標とします。

- ・資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
- ・資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
- ・下値目安値は、四半期毎に、委託者の判断により基準価額から一定の水準に設定します。
- ・上記の運用目標は、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<sup>(\*\*)</sup>を機動的に変更することで行います。

(\*) 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、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

- ・各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来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。
- ④有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引は約款の範囲で行なう事ができます。
- ⑤外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ⑥非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）については制限を設けません。
- 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。

### 3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

#### ①分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

#### ②分配対象額についての分配方針

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

#### ③留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託  
クルーズコントロール  
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5,000万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

<信託金の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として、信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から第46条第1項、第47条第1項、第48条第1項および第50条第2項の規定による信託終了の日までとします。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<受益権の分割および再分割>

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については5,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところにしたがい、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この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から

負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

- ③外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④第27条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

#### <信託日時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こととし、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条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

#### <受益権の設定にかかる受託者の通知>

第12条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

#### <受益権の申込単位および取得価額等>

第13条 委託者は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口または1円を最低単位とし、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、1口または1円を最低単位とし、販売会社が独自に定める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。また、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口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、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。）である場合には、受益権の取得申込みに応じません。
- ④第1項および第2項の場合の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額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にかかる取得価額は、1口につき1円に委託者または販売会社が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。

- ⑤前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥第1項および第2項の取得申込者は委託者または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者（第43条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）または販売会社は、当該取得申込みの代金（第4項の受益権の取得価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

#### <受益権の譲渡にかかる記載または記録>

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

- 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。

- 1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限り。）
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

#### <運用の指図範囲等>



第17条 委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・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、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、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(以下それぞれを「各マザーファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。)各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
  2. 国債証券
  3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうち、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
  6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みません。)
  8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
  9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  11. コマーシャル・ペーパー
  12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
  13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
  15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
  18. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
  20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
  21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第13号および第18号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第7号までの証券ならびに第13号および第

18号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号の証券および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ②委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図をすることができます。
1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ③委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。以下同じ。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ④前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### <利害関係人等との取引等>

- 第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第28条において同じ。）、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等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21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託者は、委託者の指図により、当該投資等および当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

#### <運用の基本方針>

- 第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

#### <投資する株式等の範囲>

第20条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場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されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

#### <信用リスク集中回避のための投資制限>

第20条の2 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### <信用取引の指図範囲>

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### <先物取引等の運用指図>

第22条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

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

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

#### <スワップ取引の運用指図>

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の

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

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

#### <金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図>

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

#### <デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第24条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

#### <有価証券の貸付の指図および範囲>

第25条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

#### <特別な場合の外貨建有価証券への投資制限>

第26条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### <外国為替予約取引の指図>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- ③前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その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28条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みませぬ。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
  2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
  3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

#### <混蔵寄託>

第29条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### <信託財産の登記等および記載等の留保等>

第30条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、信託財産に属する旨の記載または記録に代えてその計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### <一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第31条 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### <再投資の指図>

第32条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清

算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

#### <資金の借入れ>

第33条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ②一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ③収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### <損益の帰属>

第34条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### <受託者による資金の立替え>

第35条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ②信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

#### <信託の計算期間>

第36条 この信託の計算期間は、平成25年7月12日以降、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。ただし、第1期計算期間は平成24年10月26日から平成25年1月11日まで、第2計算期間は平成25年1月12日から平成25年4月11日まで、第3計算期間は平成25年4月12日から平成25年7月11日までとします。

- ②前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第5条に定める信託期間の終了日とします。

#### <信託財産に関する報告等>

第37条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

- ④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

<信託事務の諸費用および監査費用>

第38条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ②信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

<信託報酬等の額および支弁の方法>

第39条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年10,000分の140の率を乗じて得た額とします。

- ②前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者の間の配分は別に定めます。
- ③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第40条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ②前項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41条 受託者は、収益分配金については第42条第1項に規定する支払開始日までに、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42条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第45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42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42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、）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の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付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、受益者ごと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、当該受益権の取得申込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な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、）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45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、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、
- 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、

#### <委託者自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第43条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

#### <収益分配金および償還金の時効>

第44条 受益者が、収益分配金について第42条第1項に規定する支払い開始日から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42条第4項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

#### <信託契約の一部解約>

第45条 受益者（販売会社を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日が海外休業日の場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとし、

- ②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して



当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

- ③前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。
- ④一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑤委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。

#### <信託契約の解約>

第46条 委託者は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のため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、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面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も同様とします。

#### <信託契約に関する監督官庁の命令>

第47条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの約款を変更しようとするときは、第51条の規定に従います。

#### <委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第48条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第51条の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第49条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を承継させることがあります。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第50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51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51条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面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52条 この信託は、受益者が第45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46条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

<他の受益者の氏名等の開示の請求の制限>

第53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

第54条 (削除)

<公告>

第55条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am-one.co.jp/>

- ②前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第56条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<質権口記載または記録の受益権の取扱い>

第57条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<約款に関する疑義の取扱い>

第58条 この約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第3条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した

額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第42条第7項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

平成24年10月26日 (信託契約締結日)

委託者 D I A Mアセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

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  
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第15条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。  
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- 5) 有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。



- 8) 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行ないます。
- 9) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 10) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

親投資信託  
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  
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<sup>(\*)</sup>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<sup>(\*)</sup>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。