

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2024年4月11日に関東財務局長に提出しており、2024年4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】	305
第三部【委託会社等の情報】	307
第1【委託会社等の概況】	307
約款	353

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[※]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：2024年4月12日から2024年10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時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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^(*))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^(**)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^(***)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。

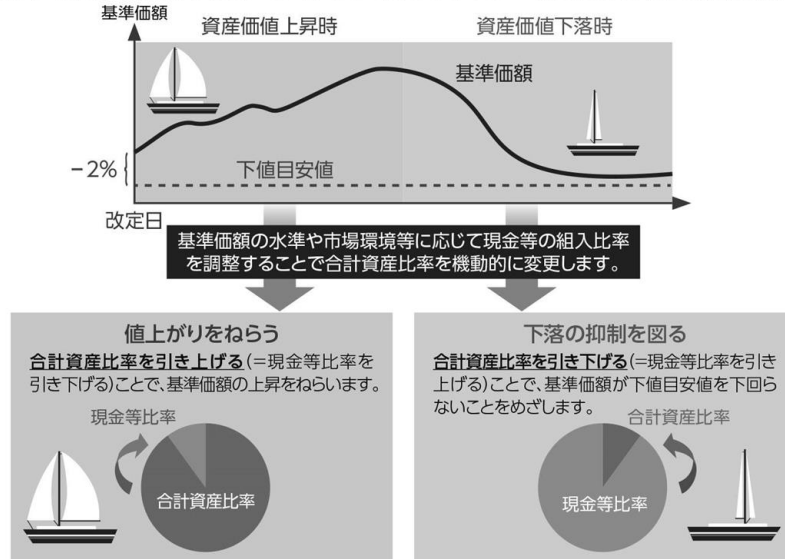
(***)合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

※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・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。

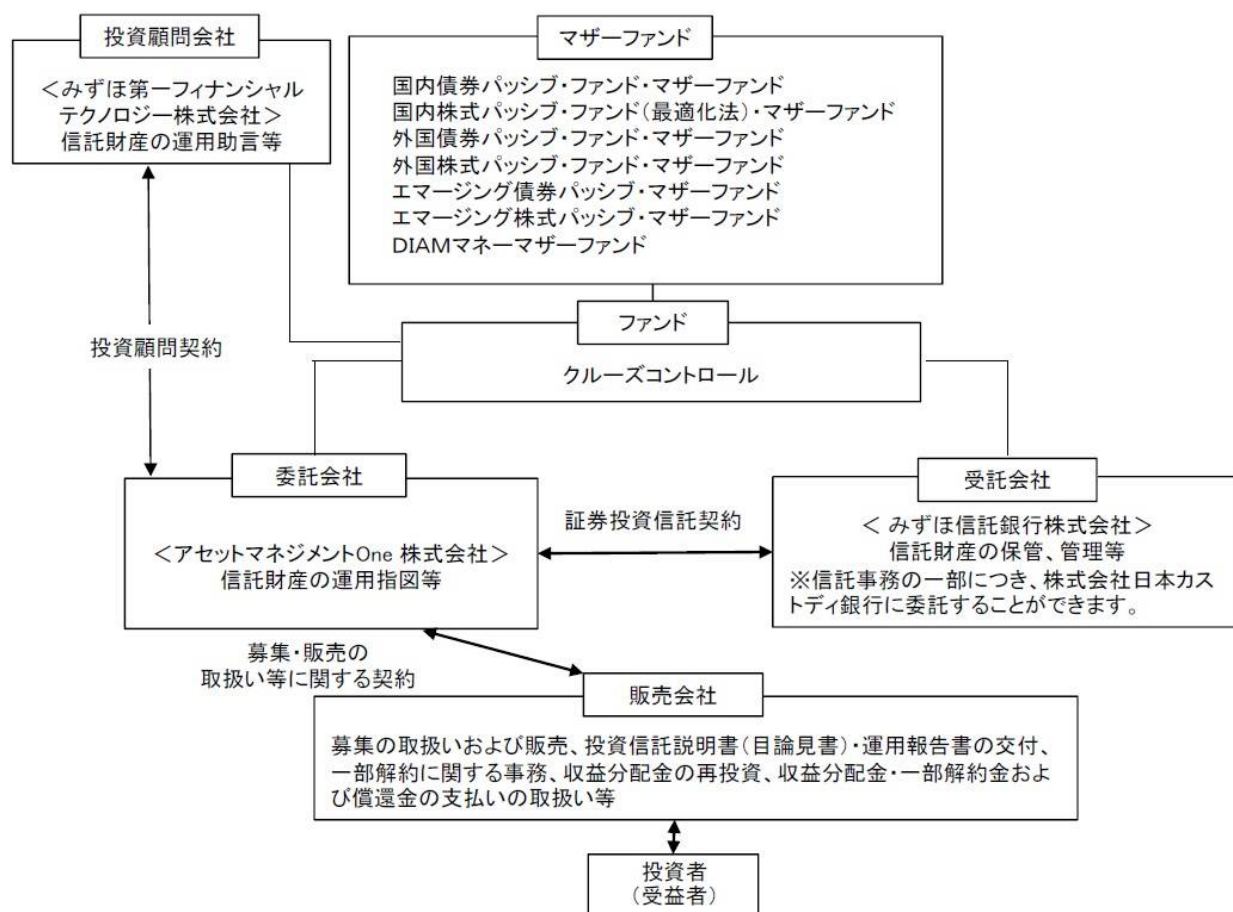
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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。

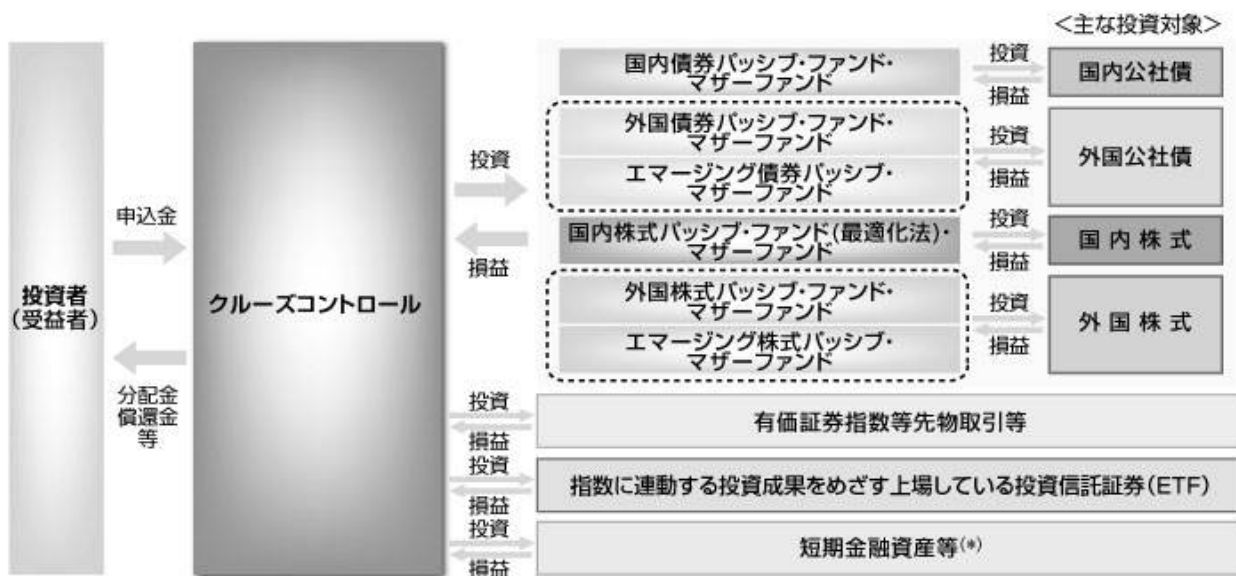
- ・「投資顧問契約」の概要

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（2024年1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

(2024年1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^(*)）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^(**)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つ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。

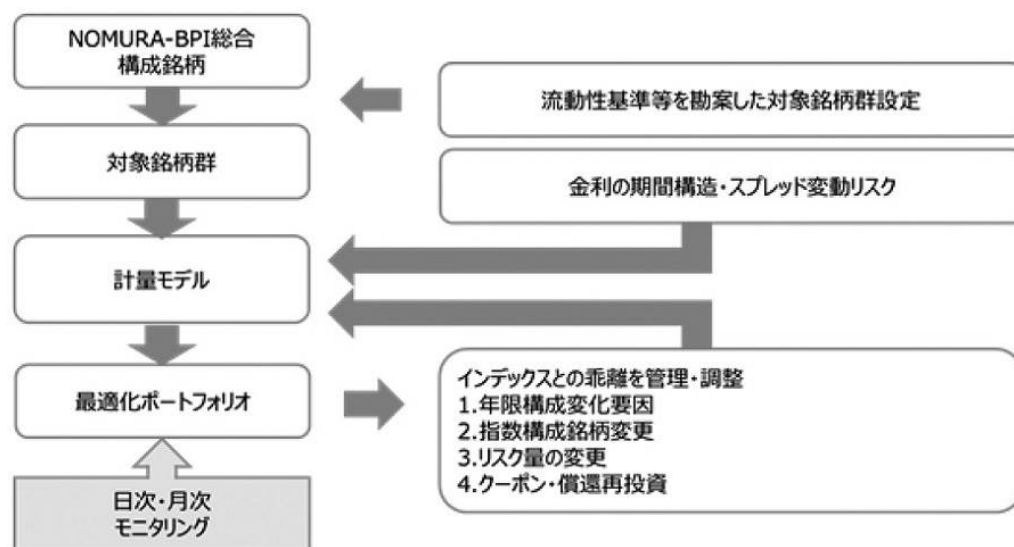
③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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つ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&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p>
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</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>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>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資



主な投資制限

1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。
2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 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。 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。 <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"> 1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

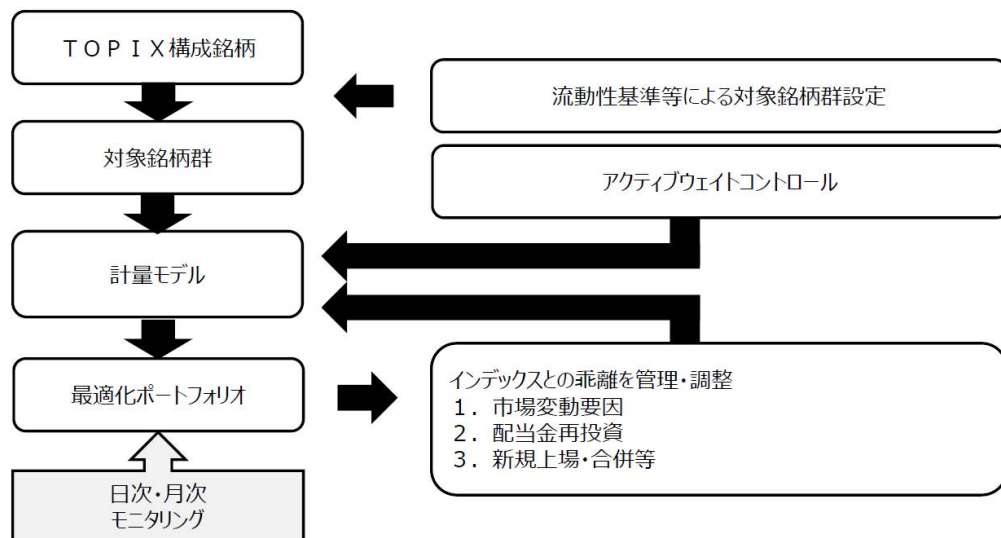
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3. インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

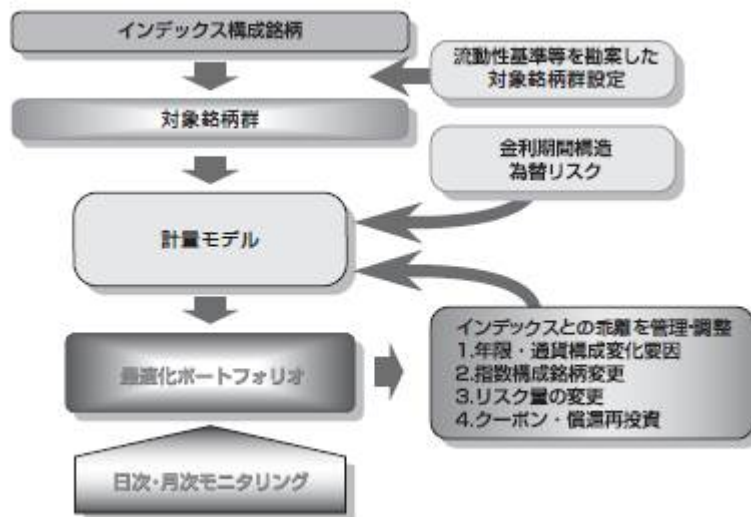
- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定



主な投資制限

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

ファンド名	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>
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資



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

<p>ファンド名</p>	<p>外国株式パッシブ・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"> 1. 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

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

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

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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、または

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

運用プロセス

1. 流動性基準による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

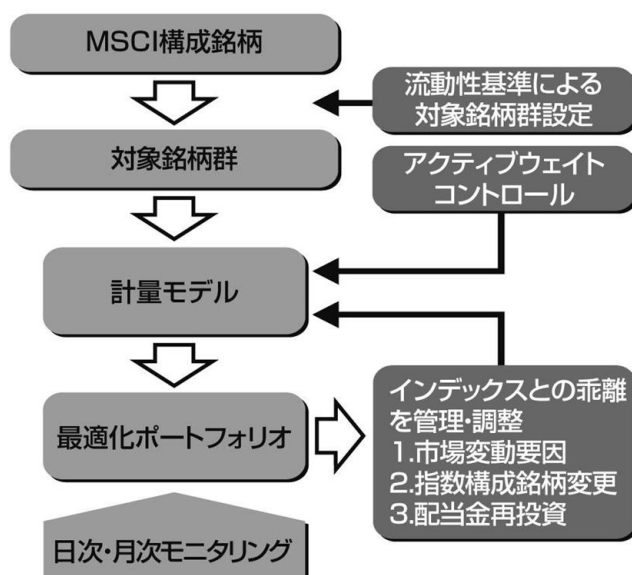
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



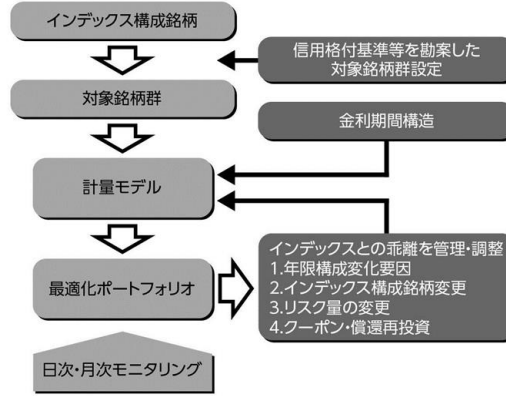
主な投資制限

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"> 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。 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。 4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>※ 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。

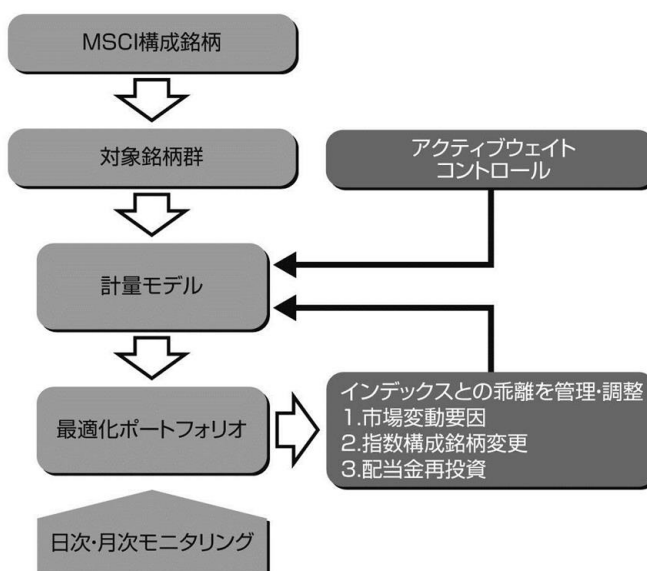
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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。



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。

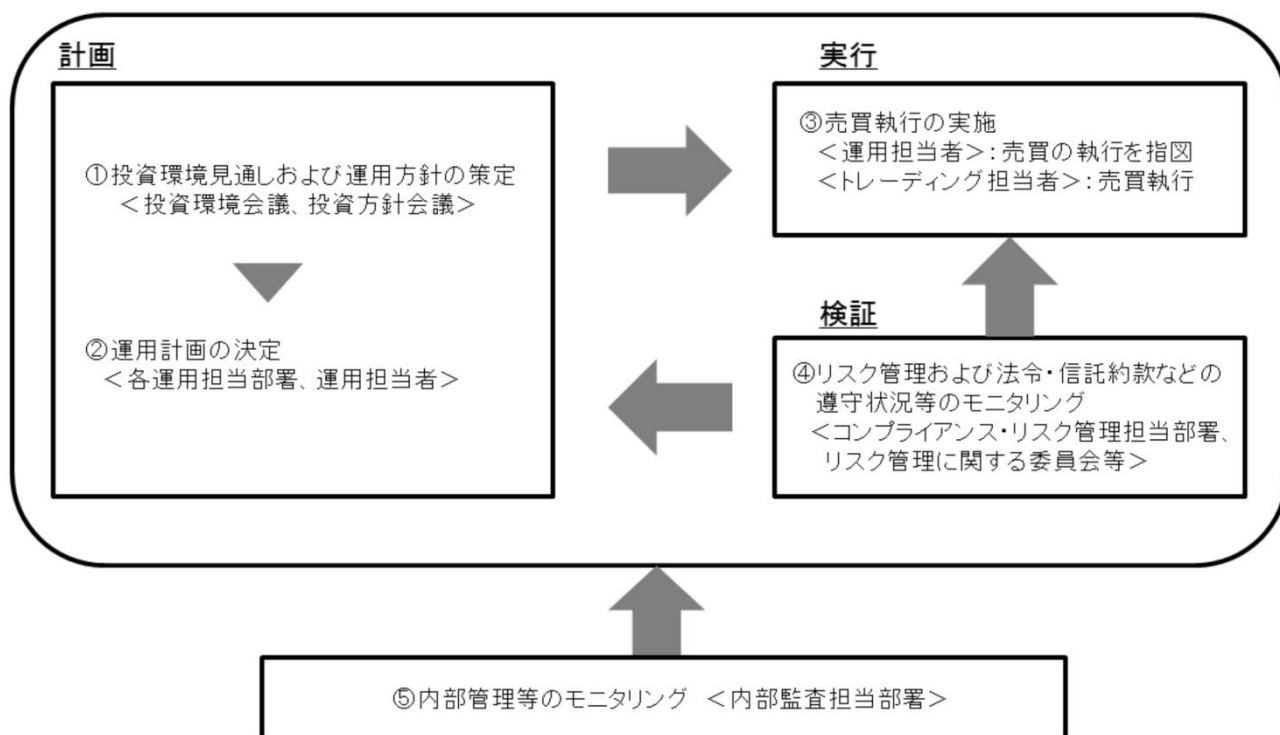
ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

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&I、JCR、Moody's、S&Pとします。</p> <p>②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	<p>マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡張等を予測し、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2024年1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、）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、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、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。

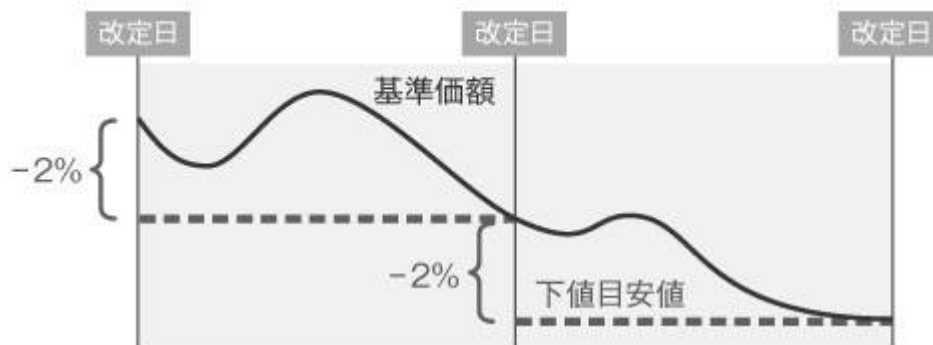
○当ファンドは下値目安値を改定日の基準価額をもとに決定し、損失の抑制をめざして合計資産比率をコントロールします。ただし損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意く

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。

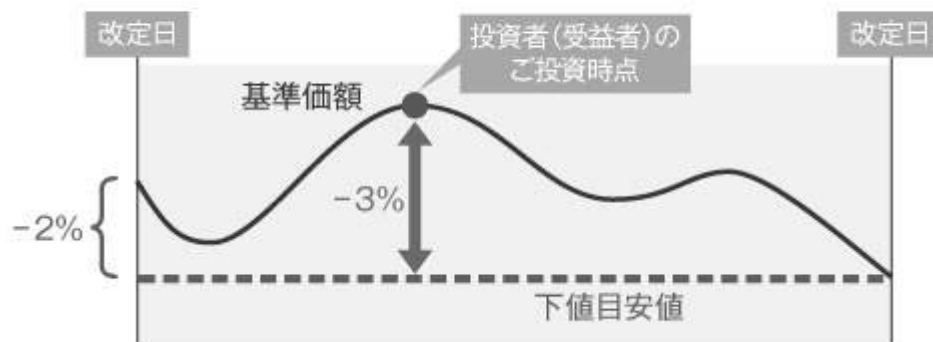
<基準価額の推移(イメージ)>



<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。

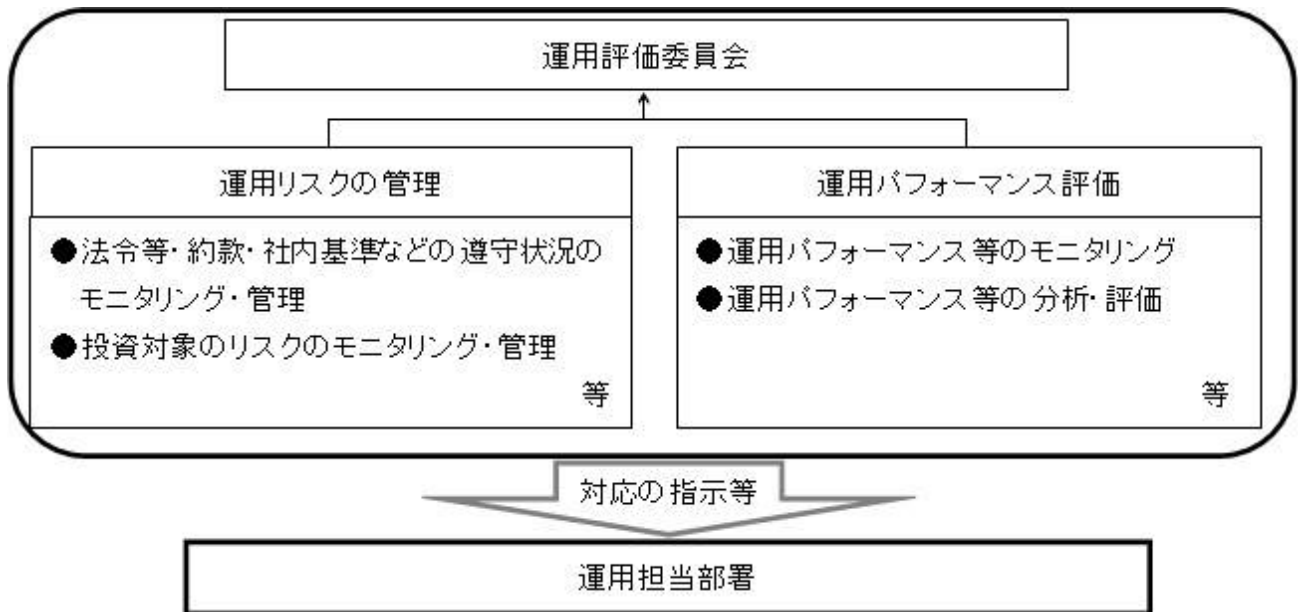
○注意事項

- 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2024年1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>

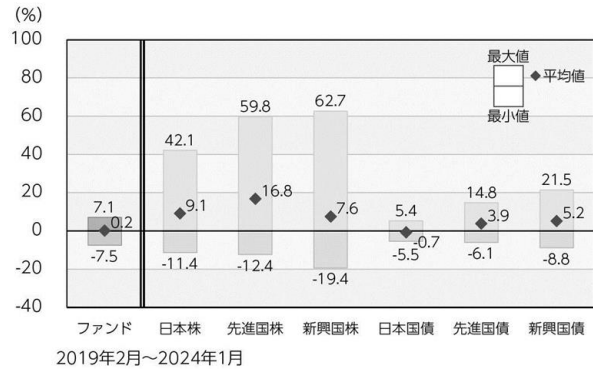
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社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・デバースファイド(円ベース)	[JPモルガンGBI-EMグローバル・デバースファイド]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。

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

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、2024年1月末現在のものです。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%	0.03%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年7月12日~2024年1月11日

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

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

※なお、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】

2024年1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	6,271,025,945	68.83
内 日本	6,271,025,945	68.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,840,378,284	31.17
純資産総額	9,111,404,229	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

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	449,420,596,350	84.35
内 日本	449,420,596,350	84.35
地方債証券	29,047,815,451	5.45
内 日本	29,047,815,451	5.45
特殊債券	28,645,989,745	5.38
内 日本	28,645,989,745	5.38
社債券	23,671,732,400	4.44
内 日本	23,278,147,400	4.37
内 フランス	393,585,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,019,453,464	0.38
純資産総額	532,805,587,410	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

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	529,185,682,560	97.83
内 日本	529,185,682,560	97.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,761,383,101	2.17
純資産総額	540,947,065,661	100.00

その他資産の投資状況

2024年1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）	11,235,400,000	2.08
内 日本	11,235,400,000	2.08

(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

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）

国債証券		253,286,849,118	99.44
内 アメリカ		120,575,324,837	47.34
内 フランス		20,936,309,925	8.22
内 中国		19,948,757,008	7.83
内 イタリア		18,639,818,642	7.32
内 ドイツ		16,317,079,828	6.41
内 イギリス		13,330,093,479	5.23
内 スペイン		12,303,860,728	4.83
内 カナダ		5,134,651,770	2.02
内 ベルギー		4,434,005,446	1.74
内 オランダ		3,775,593,921	1.48
内 オーストラリア		3,496,055,006	1.37
内 オーストリア		2,997,131,916	1.18
内 メキシコ		2,148,074,174	0.84
内 アイルランド		1,449,790,134	0.57
内 ポーランド		1,308,951,984	0.51
内 フィンランド		1,302,134,662	0.51
内 マレーシア		1,200,732,751	0.47
内 シンガポール		1,032,666,346	0.41
内 イスラエル		766,710,025	0.30
内 デンマーク		661,596,551	0.26
内 ニュージーランド		592,243,340	0.23
内 スウェーデン		508,544,665	0.20
内 ノルウェー		426,721,980	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,416,963,592	0.56
純資産総額		254,703,812,710	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

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	1,256,065,762,695	95.67
内 アメリカ	908,474,482,117	69.19
内 イギリス	48,346,184,937	3.68
内 カナダ	43,455,415,264	3.31
内 スイス	40,325,445,081	3.07
内 フランス	39,284,847,536	2.99
内 ドイツ	30,310,519,489	2.31
内 オランダ	25,078,709,864	1.91
内 オーストラリア	24,366,338,169	1.86
内 アイルランド	23,688,054,383	1.80
内 デンマーク	12,253,433,221	0.93
内 スウェーデン	10,957,626,344	0.83
内 スペイン	8,987,694,039	0.68
内 イタリア	6,955,648,497	0.53
内 香港	5,408,009,590	0.41
内 ジャージー	4,056,634,076	0.31
内 フィンランド	3,821,358,112	0.29
内 シンガポール	3,786,249,719	0.29

	内 ベルギー	2,654,828,951	0.20
	内 イスラエル	2,481,730,884	0.19
	内 ノルウェー	2,308,318,923	0.18
	内 バミューダ	1,655,582,460	0.13
	内 ケイマン諸島	1,638,985,740	0.12
	内 オランダ領キュラソー	1,545,234,026	0.12
	内 ニュージーランド	941,706,352	0.07
	内 オーストリア	722,566,476	0.06
	内 ルクセンブルグ	714,347,903	0.05
	内 ポルトガル	663,020,420	0.05
	内 リベリア	648,303,702	0.05
	内 パナマ	360,653,478	0.03
	内 マン島	173,832,942	0.01
新株予約権証券		0	0.00
	内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		2,017,846,589	0.15
	内 オーストラリア	1,507,289,537	0.11
	内 シンガポール	510,557,052	0.04
投資証券		23,072,642,515	1.76
	内 アメリカ	21,666,578,993	1.65
	内 フランス	517,644,903	0.04
	内 イギリス	422,022,800	0.03
	内 香港	304,912,223	0.02
	内 ベルギー	87,014,401	0.01
	内 カナダ	74,469,195	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		31,804,146,368	2.42
純資産総額		1,312,960,398,167	100.00

その他資産の投資状況

2024年1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）	35,437,003,878	2.70
内 アメリカ	27,175,345,860	2.07
内 ドイツ	5,048,122,099	0.38
内 イギリス	1,448,729,668	0.11
内 カナダ	1,158,258,232	0.09
内 オーストラリア	606,548,019	0.05

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	96,119,900,763	97.66
内 サウジアラビア	10,753,868,437	10.93
内 メキシコ	9,933,868,365	10.09
内 アラブ首長国連邦	8,041,461,422	8.17
内 カタール	7,355,671,600	7.47

内 ブラジル	7,191,054,736	7.31
内 チリ	6,896,947,410	7.01
内 ドミニカ共和国	6,443,838,504	6.55
内 ハンガリー	6,044,082,532	6.14
内 コロンビア	5,348,681,947	5.43
内 南アフリカ	4,704,320,123	4.78
内 パナマ	4,516,789,968	4.59
内 ルーマニア	4,416,204,992	4.49
内 インドネシア	4,250,123,767	4.32
内 ペルー	3,492,135,538	3.55
内 オマーン	2,552,159,808	2.59
内 フィリピン	2,058,237,714	2.09
内 ウルグアイ	1,185,332,583	1.20
内 中国	935,121,317	0.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,301,379,784	2.34
純資産総額	98,421,280,547	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

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	80,100,911,520	94.71
内 インド	14,410,658,842	17.04
内 台湾	13,173,043,248	15.57
内 ケイマン諸島	11,334,083,770	13.40
内 韓国	9,905,977,367	11.71
内 中国	8,229,657,691	9.73
内 ブラジル	4,394,021,641	5.20
内 サウジアラビア	3,546,976,995	4.19
内 南アフリカ	2,244,446,637	2.65
内 メキシコ	1,688,742,072	2.00
内 インドネシア	1,567,208,629	1.85
内 タイ	1,369,549,374	1.62
内 マレーシア	1,124,251,275	1.33
内 アラブ首長国連邦	1,062,571,353	1.26
内 カタール	711,622,211	0.84
内 ポーランド	710,503,082	0.84
内 クエート	689,023,214	0.81
内 香港	679,766,060	0.80
内 トルコ	571,913,693	0.68
内 フィリピン	517,714,911	0.61
内 ギリシャ	424,338,772	0.50
内 チリ	386,110,528	0.46
内 バミューダ	334,982,438	0.40
内 アメリカ	258,369,698	0.31
内 ハンガリー	217,914,772	0.26
内 チェコ	122,230,929	0.14
内 コロンビア	92,941,784	0.11
内 イギリス	92,411,406	0.11

	内 ルクセンブルグ	89,135,743	0.11
	内 オランダ	48,552,707	0.06
	内 エジプト	42,013,442	0.05
	内 ペルー	40,265,046	0.05
	内 シンガポール	19,912,190	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		723,754,700	0.86
	内 メキシコ	532,467,914	0.63
	内 ブラジル	191,286,786	0.23
投資証券		58,435,654	0.07
	内 メキシコ	58,435,654	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,695,641,814	4.37
純資産総額		84,578,743,688	100.00

その他資産の投資状況

2024年1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）	3,719,762,796	4.40
内 アメリカ	3,719,762,796	4.40

（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

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	300,157,000	60.15
内 日本	300,157,000	60.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	198,837,590	39.85
純資産総額	498,994,590	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】

2024年1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	777,048,252	2.2851 1,775,697,337	2.2998 1,787,055,569	— —	19.61
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	272,864,109	4.3505 1,187,111,466	4.4516 1,214,681,867	— —	13.33
3	国内債券パッシブ・ファン	親投資	945,871,217	1.2482	1.2344	—	12.81

	ド・マザーファンド 日本	信託受益証券		1,180,704,085	1,167,583,430	—	
4	外国株式パッシブ・ファンド ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	75,530,172	7.8607 593,721,434	8.1230 613,531,587	— —	6.73
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	261,439,093	2.2648 592,122,589	2.2885 598,303,364	— —	6.57
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受益証券	383,960,069	1.5380 590,553,323	1.5469 593,947,830	— —	6.52
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	1.0057 295,951,722	1.0057 295,922,298	— —	3.25

(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

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	68.83
合計	68.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2024年1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 5 1 回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	12,500,000,000	100.05 12,507,125,000	99.98 12,498,125,000	0.005 2025/8/1	2.35
2	1 4 5 回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	7,300,000,000	100.20 7,314,673,000	100.13 7,309,490,000	0.1 2025/9/20	1.37
3	3 5 0 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,600,000,000	99.59 6,573,160,000	99.54 6,570,234,000	0.1 2028/3/20	1.23
4	3 4 9 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,850,000,000	99.89 5,844,050,000	99.67 5,830,812,000	0.1 2027/12/20	1.09
5	1 4 7 回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,750,000,000	100.03 5,751,750,000	99.88 5,743,272,500	0.005 2026/3/20	1.08
6	1 5 5 回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,700,000,000	100.76 5,743,516,000	100.44 5,725,251,000	0.3 2027/12/20	1.07
7	3 5 7 回 利付国庫債券	国債証券	5,800,000,000	98.84	98.67	0.1	1.07

	(10年)	日本	券		5,733,150,000	5,722,976,000	2029/12/20	
8	367回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,700,000,000	96.83 5,519,343,000	96.88 5,522,445,000	0.2 2032/6/20	1.04
9	361回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,500,000,000	97.95 5,387,262,000	97.85 5,382,245,000	0.1 2030/12/20	1.01
10	372回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,300,000,000	101.68 5,389,405,000	100.94 5,350,191,000	0.8 2033/9/20	1.00
11	365回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,430,000,000	96.52 5,241,226,000	96.67 5,249,343,900	0.1 2031/12/20	0.99
12	153回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	5,210,000,000	99.58 5,188,155,000	99.57 5,188,065,900	0.005 2027/6/20	0.97
13	364回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,350,000,000	97.01 5,190,335,000	96.95 5,186,932,000	0.1 2031/9/20	0.97
14	369回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,220,000,000	99.21 5,178,992,000	98.90 5,162,893,200	0.5 2032/12/20	0.97
15	358回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,150,000,000	98.47 5,071,412,000	98.49 5,072,698,500	0.1 2030/3/20	0.95
16	371回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,200,000,000	97.21 5,054,945,000	97.53 5,071,560,000	0.4 2033/6/20	0.95
17	363回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,070,000,000	97.65 4,951,264,000	97.25 4,930,879,200	0.1 2031/6/20	0.93
18	352回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,950,000,000	99.24 4,912,398,000	99.22 4,911,489,000	0.1 2028/9/20	0.92
19	345回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,890,000,000	100.15 4,897,774,000	100.04 4,892,102,700	0.1 2026/12/20	0.92
20	370回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,900,000,000	99.16 4,858,960,000	98.66 4,834,536,000	0.5 2033/3/20	0.91
21	366回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,880,000,000	97.04 4,735,921,000	97.16 4,741,554,400	0.2 2032/3/20	0.89
22	146回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	4,700,000,000	100.19 4,709,337,000	100.09 4,704,418,000	0.1 2025/12/20	0.88
23	368回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,750,000,000	96.83 4,599,450,000	96.59 4,588,357,500	0.2 2032/9/20	0.86
24	346回 利付国庫債券		国債証	4,540,000,000	100.17	99.98	0.1	0.85

	(10年)	日本	券		4,548,002,000	4,539,273,600	2027/3/20	
25	347回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証券	4,500,000,000	100.09 4,504,234,000	99.89 4,495,455,000	0.1 2027/6/20	0.84
26	157回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証券	4,400,000,000	100.33 4,414,838,000	99.95 4,398,196,000	0.2 2028/3/20	0.83
27	156回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証券	4,300,000,000	100.40 4,317,286,000	100.05 4,302,451,000	0.2 2027/12/20	0.81
28	362回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証券	4,210,000,000	97.35 4,098,766,000	97.58 4,108,202,200	0.1 2031/3/20	0.77
29	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	100.08 4,093,394,700	0.1 2026/6/20	0.77
30	355回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証券	4,130,000,000	98.68 4,075,618,000	98.88 4,084,074,400	0.1 2029/6/20	0.77

(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

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.35
地方債証券	5.45
特殊債券	5.38
社債券	4.44
合計	99.62

(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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年1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	8,028,600	2,054.32 16,493,366,654	3,000.00 24,085,800,000	— —	4.45
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,034,300	12,226.87 12,646,259,255	14,695.00 15,199,038,500	— —	2.81
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,769,700	994.70 8,723,294,779	1,395.00 12,233,731,500	— —	2.26
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	146,300	60,891.06 8,908,363,331	66,580.00 9,740,654,000	— —	1.80
5	東京エレクトロン	株式	309,500	16,897.03	27,865.00	—	1.59

		日本	電気機器		5,229,632,134	8,624,217,500	—	
6	日立製作所	日本	株式 電気機器	709,700	7,564.57 5,368,579,829	11,675.00 8,285,747,500	— —	1.53
7	日本電信電話	日本	株式 情報・通 信業	43,620,300	158.78 6,926,213,734	186.30 8,126,461,890	— —	1.50
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式 銀行業	1,023,900	5,927.32 6,068,988,216	7,700.00 7,884,030,000	— —	1.46
9	三菱商事	日本	株式 卸売業	3,065,300	1,750.03 5,364,379,896	2,565.00 7,862,494,500	— —	1.45
10	信越化学工業	日本	株式 化学	1,328,100	4,092.58 5,435,360,078	5,875.00 7,802,587,500	— —	1.44
11	任天堂	日本	株式 その他製 品	923,100	5,788.49 5,343,355,800	8,310.00 7,670,961,000	— —	1.42
12	三井物産	日本	株式 卸売業	1,165,600	4,323.63 5,039,627,192	6,031.00 7,029,733,600	— —	1.30
13	伊藤忠商事	日本	株式 卸売業	1,039,900	4,483.06 4,661,942,457	6,752.00 7,021,404,800	— —	1.30
14	リクルートホールディングス	日本	株式 サービ ス業	1,112,800	4,408.45 4,905,725,838	5,927.00 6,595,565,600	— —	1.22
15	本田技研工業	日本	株式 輸送用機 器	3,565,600	1,198.31 4,272,724,468	1,675.50 5,974,162,800	— —	1.10
16	武田薬品工業	日本	株式 医薬品	1,297,800	4,230.01 5,489,718,020	4,362.00 5,661,003,600	— —	1.05
17	第一三共	日本	株式 医薬品	1,277,500	4,133.29 5,280,285,556	4,423.00 5,650,382,500	— —	1.04
18	東京海上ホールディングス	日本	株式 保険業	1,423,400	2,861.79 4,073,481,211	3,930.00 5,593,962,000	— —	1.03
19	KDDI	日本	株式 情報・通 信業	1,133,200	4,089.42 4,634,132,117	4,897.00 5,549,280,400	— —	1.03
20	HOYA	日本	株式 精密機器	287,800	14,591.99 4,199,576,596	18,945.00 5,452,371,000	— —	1.01
21	みずほフィナンシャルグループ	日本	株式 銀行業	1,943,700	2,155.61 4,189,868,111	2,702.00 5,251,877,400	— —	0.97
22	ソフトバンクグループ	日本	株式 情報・通 信業	723,400	6,211.58 4,493,462,853	6,460.00 4,673,164,000	— —	0.86
23	ソフトバンク	日本	株式 情報・通 信業	2,360,000	1,568.30 3,701,208,848	1,963.50 4,633,860,000	— —	0.86
24	オリエンタルランド	日本	株式 サービ ス業	795,400	4,480.40 3,563,717,771	5,502.00 4,376,290,800	— —	0.81
25	ダイキン工業		株式	176,300	23,064.36	23,885.00	—	0.78

		日本	機械		4,066,246,850	4,210,925,500	—	
26	村田製作所	日本	株式 電気機器	1,330,300	2,612.39 3,475,269,493	3,015.00 4,010,854,500	— —	0.74
27	SMC	日本	株式 機械	44,200	69,227.21 3,059,842,959	82,910.00 3,664,622,000	— —	0.68
28	三菱電機	日本	株式 電気機器	1,643,600	1,597.35 2,625,407,132	2,203.00 3,620,850,800	— —	0.67
29	日本たばこ産業	日本	株式 食料品	874,800	2,826.44 2,472,577,844	3,895.00 3,407,346,000	— —	0.63
30	丸紅	日本	株式 卸売業	1,289,800	1,884.00 2,429,984,533	2,541.50 3,278,026,700	— —	0.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	97.83
合計	97.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	17.08
輸送用機器		8.42
情報・通信業		7.46
卸売業		7.11
銀行業		6.99
化学		5.77
機械		5.27
サービス業		4.61
医薬品		4.47
小売業		4.10
食料品		3.23
陸運業		2.65
保険業		2.39
その他製品		2.38
精密機器		2.31
建設業		2.06
不動産業		1.89
電気・ガス業		1.35
その他金融業		1.13
鉄鋼		0.95
海運業		0.89
証券、商品先物取引業		0.85
ゴム製品		0.69
ガラス・土石製品		0.66
非鉄金属		0.65
金属製品		0.51
石油・石炭製品		0.45

空運業	0.43
繊維製品	0.37
鉱業	0.34
パルプ・紙	0.16
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	97.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年1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	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証 券	1,325,340,060	99.93 1,324,538,237	101.52 1,345,542,218	2.68 2030/5/21	0.53
2	US T N/B 1.0 07/31/28 アメリカ	国債証 券	1,367,788,500	86.16 1,178,608,927	87.66 1,199,058,957	1 2028/7/31	0.47
3	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	1,429,759,500	81.49 1,165,158,896	82.79 1,183,768,258	1.125 2031/2/15	0.46
4	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証 券	1,180,400,000	96.65 1,140,888,110	98.65 1,164,538,375	3.875 2033/8/15	0.46
5	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証 券	1,140,695,160	100.55 1,147,035,780	101.28 1,155,367,807	2.69 2026/8/12	0.45
6	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 中国	国債証 券	1,107,869,400	102.21 1,132,407,568	103.18 1,143,104,632	3.01 2028/5/13	0.45
7	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	1,398,774,000	80.44 1,125,196,233	81.61 1,141,558,033	0.875 2030/11/15	0.45
8	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証 券	1,121,380,000	103.19 1,157,212,628	100.57 1,127,862,975	4.125 2032/11/15	0.44
9	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	1,165,645,000	96.05 1,119,680,371	95.88 1,117,698,742	3.5 2033/2/15	0.44
10	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証 券	1,355,984,500	82.03 1,112,414,141	82.41 1,117,521,903	1.375 2031/11/15	0.44
11	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	1,289,587,000	83.52 1,077,112,246	85.09 1,097,383,118	1.625 2031/5/15	0.43
12	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,187,777,500	92.10 1,093,950,090	91.81 1,090,574,609	2.875 2032/5/15	0.43
13	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,322,048,000	80.60 1,065,600,198	82.16 1,086,248,337	1.25 2031/8/15	0.43
14	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証 券	1,156,792,000	91.93 1,063,506,550	90.67 1,048,884,993	2.75 2032/8/15	0.41
15	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	1,221,714,000	84.83 1,036,390,835	85.27 1,041,869,108	1.875 2032/2/15	0.41
16	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証 券	984,772,800	101.66 1,001,211,776	101.97 1,004,214,381	3.03 2026/3/11	0.39
17	US T N/B 1.5 08/15/26	国債証	1,037,276,500	91.47	93.52	1.5	0.38

	アメリカ	券		948,882,780	970,096,642	2026/8/15	
18	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	1,142,037,000	79.50 907,983,991	80.59 920,455,050	0.625 2030/8/15	0.36
19	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証 券	959,075,000	94.04 901,963,095	94.84 909,622,695	3.375 2033/5/15	0.36
20	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証 券	885,300,000	97.86 866,434,257	98.87 875,305,795	3.75 2026/4/15	0.34
21	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	924,626,600	90.33 835,272,692	93.00 859,983,180	1.5 2031/5/25	0.34
22	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証 券	898,579,500	92.44 830,699,813	94.74 851,368,974	1.625 2026/2/15	0.33
23	US T N/B 2.75 04/30/27 アメリカ	国債証 券	885,300,000	94.17 833,762,998	95.91 849,109,899	2.75 2027/4/30	0.33
24	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証 券	830,902,050	99.64 827,944,355	100.25 833,025,586	2.26 2025/2/24	0.33
25	US T N/B 3.75 06/30/30 アメリカ	国債証 券	841,035,000	93.37 785,350,072	98.41 827,663,855	3.75 2030/6/30	0.32
26	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証 券	885,300,000	90.27 799,229,882	92.52 819,109,993	0.75 2026/4/30	0.32
27	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証 券	810,385,950	100.15 811,679,159	100.24 812,360,536	2.3 2026/5/15	0.32
28	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証 券	846,937,000	90.39 765,621,908	92.66 784,773,143	1.5 2027/1/31	0.31
29	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証 券	843,986,000	90.88 767,017,463	92.79 783,176,149	0.75 2026/3/31	0.31
30	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証 券	841,035,000	89.75 754,831,863	92.45 777,612,414	0.375 2026/1/31	0.31

(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

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.44
合計	99.44

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2024年1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	2,350,542	23,623.17 55,527,267,851	27,745.30 65,216,497,653	— —	4.97

2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,060,970	42,499.27 45,090,457,537	60,287.45 63,963,180,600	— —	4.87
3	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	371,467	42,214.68 15,681,364,146	92,623.03 34,406,401,685	— —	2.62
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,396,226	15,922.68 22,231,661,045	23,460.44 32,756,090,261	— —	2.49
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	894,177	15,401.34 13,771,526,958	22,347.92 19,982,998,744	— —	1.52
6	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	334,116	31,327.73 10,467,098,953	59,028.85 19,722,484,248	— —	1.50
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	783,554	15,262.43 11,958,943,993	22,582.52 17,694,629,752	— —	1.35
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	429,981	31,670.75 13,617,823,404	28,269.10 12,155,177,822	— —	0.93
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	66,816	103,533.67 6,917,706,035	178,264.00 11,910,887,958	— —	0.91
10	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	121,042	58,699.87 7,105,149,970	95,166.79 11,519,179,684	— —	0.88
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	435,612	21,070.07 9,178,378,427	26,008.63 11,329,675,034	— —	0.86
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	197,086	47,070.40 9,276,918,230	57,123.98 11,258,337,214	— —	0.86
13	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	139,147	73,485.25 10,225,252,712	74,307.65 10,339,687,339	— —	0.79

14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	241,677	34,108.34 8,243,203,344	40,893.48 9,883,014,170	— —	0.75
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	600,687	16,868.87 10,132,914,182	15,470.61 9,292,998,814	— —	0.71
16	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	361,496	23,696.21 8,566,087,570	23,426.51 8,468,590,924	— —	0.64
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	126,146	55,213.13 6,964,916,207	65,687.78 8,286,251,263	— —	0.63
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	353,784	20,993.70 7,427,237,594	23,237.64 8,221,108,590	— —	0.63
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	150,144	46,021.64 6,909,873,895	52,690.10 7,911,103,125	— —	0.60
20	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	489,820	11,572.08 5,668,237,257	16,056.37 7,864,732,133	— —	0.60
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	60,741	98,327.02 5,972,482,087	128,183.96 7,786,021,975	— —	0.59
22	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	66,410	75,926.64 5,042,288,578	103,394.18 6,866,407,958	— —	0.52
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	380,439	15,929.40 6,060,166,111	17,950.93 6,829,234,999	— —	0.52
24	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	401,274	18,699.54 7,503,641,287	16,950.96 6,801,981,569	— —	0.52
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	264,718	22,338.06 5,913,286,877	24,333.94 6,441,633,517	— —	0.49
26	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	68,332	61,132.21 4,177,286,577	92,655.49 6,331,335,489	— —	0.48
27	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	146,338	26,722.48 3,910,515,454	42,454.56 6,212,715,620	— —	0.47
28	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	242,950	13,636.91 3,313,087,372	25,387.45 6,167,881,706	— —	0.47
29	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	272,487	24,830.54 6,766,002,035	22,150.20 6,035,643,182	— —	0.46
30	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	66,811	54,633.67 3,650,130,128	83,048.51 5,548,554,502	— —	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	95.67
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.15
投資証券	1.76
合計	97.58

(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

2024年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率 (%)
ソフトウェア	外国	8.99
半導体・半導体製造装置		7.03
銀行		5.30
コンピュータ・周辺機器		5.24
医薬品		4.89
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.53
石油・ガス・消耗燃料		4.26
資本市場		3.12
金融サービス		3.09
保険		3.01
大規模小売り		2.90
ヘルスケア機器・用品		2.17
ホテル・レストラン・レジャー		2.04
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.97
バイオテクノロジー		1.81
機械		1.80
化学		1.75
生活必需品流通・小売り		1.68
航空宇宙・防衛		1.66
専門小売り		1.58
自動車		1.52
電力		1.51
飲料		1.51
情報技術サービス		1.44
金属・鉱業		1.36
食品		1.36
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.20
繊維・アパレル・贅沢品		1.19
陸上運輸		1.08
娯楽		1.04
家庭用品		1.02
専門サービス		0.99
各種電気通信サービス		0.96
コングロマリット		0.89
電気設備		0.87

総合公益事業	0.68
通信機器	0.67
メディア	0.66
建設関連製品	0.61
パーソナルケア用品	0.59
商業サービス・用品	0.57
タバコ	0.50
電子装置・機器・部品	0.48
航空貨物・物流サービス	0.47
商社・流通業	0.46
消費者金融	0.40
不動産管理・開発	0.32
建設資材	0.31
建設・土木	0.31
家庭用耐久財	0.30
エネルギー設備・サービス	0.24
無線通信サービス	0.22
容器・包装	0.20
自動車用部品	0.15
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12
運送インフラ	0.10
ガス	0.09
紙製品・林産品	0.09
水道	0.09
販売	0.08
海上運輸	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.06
旅客航空輸送	0.05
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.01
合計	95.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年1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	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証 券	2,065,700,000	103.66 2,141,419,709	107.17 2,213,965,617	7.125 2033/1/17	2.25
2	BRAZIL 3.75 09/12/31 ブラジル	国債証 券	2,508,350,000	85.74 2,150,893,575	87.75 2,201,100,954	3.75 2031/9/12	2.24
3	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証 券	2,360,800,000	88.07 2,079,333,620	91.87 2,168,961,392	4.817 2049/3/14	2.20
4	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証 券	1,918,150,000	95.42 1,830,481,692	98.21 1,883,962,812	4 2029/3/14	1.91
5	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証 券	1,770,600,000	97.56	97.88	4.375	1.76

	サウジアラビア			1,727,540,483	1,733,187,222	2029/4/16	
6	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証 券	1,770,600,000	94.49 1,673,087,144	96.92 1,716,085,191	5.5 2029/2/22	1.74
7	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証 券	1,800,110,000	87.43 1,573,868,634	90.60 1,630,959,063	3.25 2030/10/22	1.66
8	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証 券	1,770,600,000	86.62 1,533,794,054	91.38 1,618,062,810	4.85 2029/9/30	1.64
9	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証 券	1,918,150,000	74.74 1,433,766,958	79.58 1,526,576,940	2.125 2031/9/22	1.55
10	INDONESIA 3.85 10/15/30 インドネシア	国債証 券	1,534,520,000	91.05 1,397,325,059	94.38 1,448,324,415	3.85 2030/10/15	1.47
11	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証 券	1,918,150,000	68.30 1,310,159,896	74.49 1,428,946,942	5.75 2049/9/30	1.45
12	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証 券	1,327,950,000	100.93 1,340,305,837	103.99 1,380,935,205	6.25 2032/9/22	1.40
13	ROMANIA 4.0 02/14/51 ルーマニア	国債証 券	1,918,150,000	68.07 1,305,824,139	71.41 1,369,856,413	4 2051/2/14	1.39
14	DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49 ドミニカ共和国	国債証 券	1,475,500,000	81.99 1,209,887,867	92.44 1,363,954,885	6.4 2049/6/5	1.39
15	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証 券	1,623,050,000	77.28 1,254,423,474	82.58 1,340,353,643	3 2034/1/15	1.36
16	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33 サウジアラビア	国債証 券	1,623,050,000	77.16 1,252,345,380	80.46 1,306,063,465	2.25 2033/2/2	1.33
17	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証 券	1,327,950,000	95.75 1,271,622,654	96.66 1,283,666,267	2.875 2025/6/6	1.30
18	COLOMBIA 3.25 04/22/32 コロンビア	国債証 券	1,623,050,000	72.50 1,176,873,047	78.12 1,268,049,102	3.25 2032/4/22	1.29
19	PANAMA 3.16 01/23/30 パナマ	国債証 券	1,475,500,000	83.81 1,236,763,509	83.33 1,229,681,331	3.16 2030/1/23	1.25
20	REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41 チリ	国債証 券	1,623,050,000	69.55 1,128,849,305	74.27 1,205,579,271	3.1 2041/5/7	1.22
21	OMAN GOV INTERNL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証 券	1,180,400,000	99.10 1,169,811,812	101.97 1,203,659,782	6 2029/8/1	1.22
22	UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41 メキシコ	国債証 券	1,475,500,000	75.49 1,113,964,137	80.38 1,186,036,350	4.28 2041/8/14	1.21
23	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証 券	1,327,950,000	85.13 1,130,536,362	88.52 1,175,595,624	7.3 2052/4/20	1.19
24	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証 券	1,180,400,000	96.05 1,133,877,485	98.92 1,167,663,484	5.25 2029/6/16	1.19
25	BRAZIL 6.0 10/20/33 ブラジル	国債証 券	1,180,400,000	95.44 1,126,618,025	98.55 1,163,338,687	6 2033/10/20	1.18
26	ABU DHABI GOVT INT'L	国債証	1,180,400,000	96.35	97.90	2.125	1.17

	2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	券		1,137,385,043	1,155,717,836	2024/9/30	
27	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,180,400,000	96.41 1,138,123,974	97.04 1,145,560,494	2.5 2025/4/16	1.16
28	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	1,032,850,000	99.76 1,030,371,160	103.66 1,070,700,853	5.5 2032/10/25	1.09
29	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	1,180,400,000	91.15 1,075,978,865	86.20 1,017,504,800	4.4 2050/4/16	1.03
30	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証券	1,032,850,000	97.70 1,009,153,470	97.85 1,010,643,725	3.4 2025/4/16	1.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.66
合計	97.66

(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

2024年1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	1,992,751	2,507.43 4,996,696,678	3,040.76 6,059,495,066	— —	7.16
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	386,689	7,374.21 2,851,529,590	8,239.86 3,186,267,090	— —	3.77
3	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	539,400	6,772.09 3,652,865,897	5,166.60 2,786,867,276	— —	3.29
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,316,768	1,725.45 2,272,021,514	1,342.60 1,767,893,375	— —	2.09

5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	246,652	3,860.66 952,240,540	5,039.29 1,242,952,806	— —	1.47
6	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小売り	48,415	11,151.07 539,879,106	18,485.06 894,954,373	— —	1.06
7	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	268,711	2,287.99 614,809,779	2,956.09 794,335,377	— —	0.94
8	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	416,924	1,631.10 680,045,171	1,820.25 758,906,327	— —	0.90
9	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,770,530	98.72 767,131,670	87.74 681,829,040	— —	0.81
10	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	44,244	10,515.05 465,228,130	15,182.20 671,721,699	— —	0.79
11	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	227,205	2,897.80 658,395,024	2,585.29 587,392,404	— —	0.69
12	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	275,689	2,254.99 621,678,485	2,049.28 564,965,702	— —	0.67
13	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	123,366	3,396.99 419,073,287	4,561.15 562,691,225	— —	0.67
14	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	158,494	2,979.75 472,272,727	3,472.02 550,294,496	— —	0.65
15	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・レストラン・レジャー	410,510	2,488.63 1,021,607,849	1,234.09 506,609,569	— —	0.60
16	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	74,066	5,687.45 421,246,946	6,802.98 503,869,849	— —	0.60
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,009,392	492.30 496,931,271	483.11 487,650,195	— —	0.58
18	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	389,112	820.20 319,152,738	1,201.32 467,450,493	— —	0.55
19	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	156,800	2,818.44 441,931,552	2,877.67 451,219,440	— —	0.53
20	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン	65,955	6,248.48 412,118,694	6,631.81 437,401,688	— —	0.52

		ピ ュー タ・周 辺 機 器					
21	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	4,499,300	84.91 382,074,286	90.71 408,131,503	— —	0.48
22	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	239,164	1,474.78 352,714,615	1,659.16 396,811,581	— —	0.47
23	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	395,847	787.75 311,828,764	966.24 382,485,328	— —	0.45
24	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,278,235	78.55 414,606,668	71.89 379,477,121	— —	0.45
25	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小 売り	15,109	26,079.07 394,028,749	25,006.88 377,828,972	— —	0.45
26	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信 サービス	181,756	1,406.44 255,629,584	2,073.98 376,958,945	— —	0.45
27	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	298,710	924.74 276,230,734	1,256.44 375,313,198	— —	0.44
28	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,396,200	58.64 375,076,015	55.66 356,054,067	— —	0.42
29	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	182,250	2,441.77 445,012,646	1,951.15 355,598,545	— —	0.42
30	LARSEN & TOUBRO LTD インド	株式 建設・土 木	54,438	4,107.15 223,585,443	6,503.60 354,043,357	— —	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	94.71
投資信託受益証券	0.86
投資証券	0.07
合計	95.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
銀行	外国	16.61
半導体・半導体製造装置		10.26
コンピュータ・周辺機器		6.14

石油・ガス・消耗燃料	5.26
インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.51
大規模小売り	4.35
金属・鉱業	3.65
自動車	2.82
情報技術サービス	2.45
保険	2.42
化学	2.33
電子装置・機器・部品	2.28
ホテル・レストラン・レジャー	1.73
食品	1.52
無線通信サービス	1.49
生活必需品流通・小売り	1.43
不動産管理・開発	1.42
電気設備	1.38
各種電気通信サービス	1.31
医薬品	1.27
コングロマリット	1.21
金融サービス	1.19
飲料	1.15
電力	1.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	1.02
娯楽	0.97
資本市場	0.89
繊維・アパレル・贅沢品	0.83
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.81
建設資材	0.72
バイオテクノロジー	0.72
建設・土木	0.71
運送インフラ	0.70
パーソナルケア用品	0.69
専門小売り	0.68
消費者金融	0.65
機械	0.62
自動車用部品	0.62
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.47
航空宇宙・防衛	0.38
ガス	0.37
旅客航空輸送	0.35
タバコ	0.33
陸上運輸	0.32
家庭用耐久財	0.30
海上運輸	0.30
各種消費者サービス	0.25
ソフトウェア	0.22
航空貨物・物流サービス	0.22
通信機器	0.21
紙製品・林産品	0.17
ヘルスケア機器・用品	0.17
商社・流通業	0.15

水道		0.12
家庭用品		0.09
メディア		0.07
商業サービス・用品		0.07
建設関連製品		0.05
エネルギー設備・サービス		0.05
総合公益事業		0.05
容器・包装		0.02
合計		94.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

D I A Mマネーマザーファンド

2024年1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 4 1 回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	100.03 100,034,000	100.06 100,066,000	0.005 2024/10/1	20.05
2	4 4 0 回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	100.07 100,073,000	100.06 100,064,000	0.005 2024/9/1	20.05
3	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	100.02 100,027,000	0.005 2024/4/1	20.05

(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

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	60.15
合計	60.15

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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マナーマザーファンド

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

2024年1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 0603月	買建	440	10,644,474,600	11,235,400,000	2.08

(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

2024年1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 Mar24	買建	744	26,407,244,825	27,175,345,860	2.07
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar24	買建	674	4,915,542,562	5,048,122,099	0.38
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar24	買建	101	1,438,449,934	1,448,729,668	0.11
	モンテリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar24	買建	41	1,138,460,199	1,158,258,232	0.09
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Mar24	買建	33	594,699,357	606,548,019	0.05

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年1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 Mar24	買建	511	3,757,102,721	3,719,762,796	4.40

(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(2024年1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
第24計算期間末 (2024年1月11日)	9,300	9,300	1.2833	1.2833
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	—
8月末日	10,157	—	1.2740	—
9月末日	9,940	—	1.2616	—
10月末日	9,702	—	1.2438	—
11月末日	9,674	—	1.2664	—
12月末日	9,219	—	1.2678	—
2024年1月末日	9,111	—	1.2899	—

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
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
第24計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
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
第24計算期間	2.1

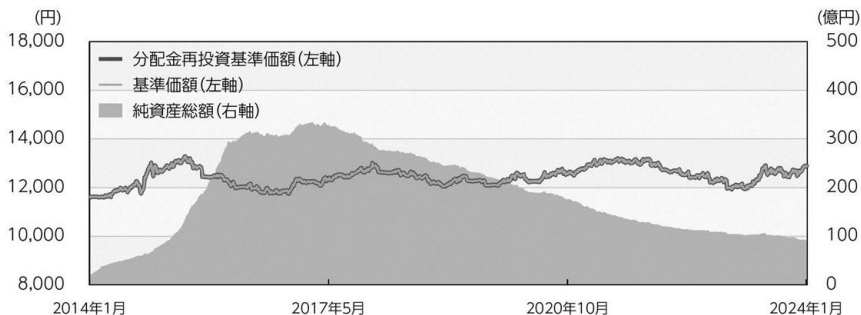
(注) 収益率は期間騰落率です。

(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
第24計算期間	108,201,861	1,005,962,085

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

基準価額・純資産の推移 《2014年1月31日～2024年1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)

2022年 1月	0円
2022年 7月	0円
2023年 1月	0円
2023年 7月	0円
2024年 1月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.61
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	13.33
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.81
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.73
5	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	6.57
6	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	6.52
7	DIAMマネーマザーファンド	3.25

■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	451回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2025/8/1	2.35
2	145回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.37
3	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.23
4	349回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/12/20	1.09
5	147回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/3/20	1.08

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.45
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.81
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.26
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.80
5	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.59

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	中国	2.68	2030/5/21	0.53
2	US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	アメリカ	1	2028/7/31	0.47
3	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.46
4	US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	アメリカ	3.875	2033/8/15	0.46
5	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	中国	2.69	2026/8/12	0.45

○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	4.97
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.87
3	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.62
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.49
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	1.52

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	ルーマニア	7.125	2033/1/17	2.25
2	BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	ブラジル	3.75	2031/9/12	2.24
3	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	2.20
4	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国債証券	カタール	4	2029/3/14	1.91
5	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	1.76

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	7.16
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.77
3	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	3.29
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.09
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.47

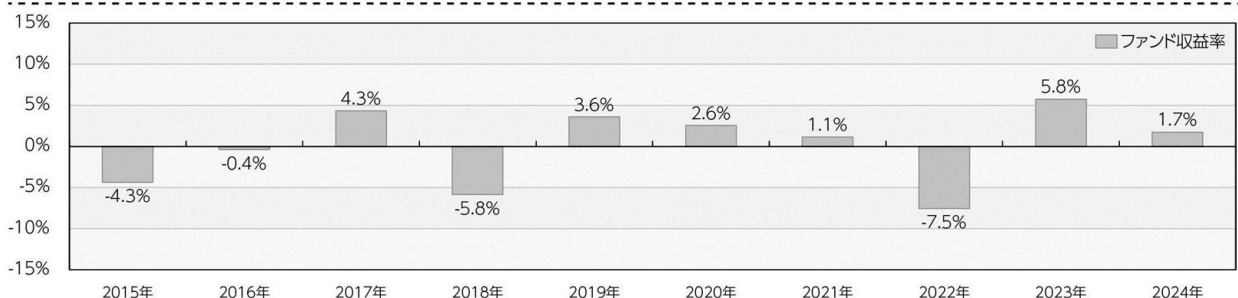
■DIAMマネーマザーファンド

※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	441回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2024/10/1	20.05
2	440回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2024/9/1	20.05
3	435回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2024/4/1	20.05

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。

※2024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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

<基準価額の照会方法等>

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、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24期計算期間（2023年7月12日から2024年1月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年3月15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 森重 俊寛
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7月12日から2024年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、クルーズコントロールの2024年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

1【財務諸表】

【クルーズコントロール】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第23期 2023年7月11日現在	第24期 2024年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	218,901,719	1,503,344,930
親投資信託受益証券	10,119,213,890	7,888,861,966
流動資産合計	10,338,115,609	9,392,206,896
資産合計	10,338,115,609	9,392,206,896
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,813,794	15,176,003
未払受託者報酬	2,826,537	2,722,202
未払委託者報酬	76,317,709	73,500,861
その他未払費用	201,159	193,727
流動負債合計	97,159,199	91,592,793
負債合計	97,159,199	91,592,793
純資産の部		
元本等		
元本	8,145,089,705	7,247,329,481
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,095,866,705	2,053,284,622
(分配準備積立金)	551,376,251	534,401,753
元本等合計	10,240,956,410	9,300,614,103
純資産合計	10,240,956,410	9,300,614,103
負債純資産合計	10,338,115,609	9,392,206,896

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第23期 自 2023年1月12日 至 2023年7月11日	第24期 自 2023年7月12日 至 2024年1月11日
営業収益		
受取利息	8,232	10,802
有価証券売買等損益	567,903,729	270,648,076
営業収益合計	567,911,961	270,658,878
営業費用		
支払利息	332,973	480,971
受託者報酬	2,826,537	2,722,202
委託者報酬	76,317,709	73,500,861
その他費用	201,159	199,667
営業費用合計	79,678,378	76,903,701
営業利益又は営業損失(△)	488,233,583	193,755,177
経常利益又は経常損失(△)	488,233,583	193,755,177
当期純利益又は当期純損失(△)	488,233,583	193,755,177
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(△)	24,263,745	5,983,194
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,738,708,820	2,095,866,705
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,481,012	28,549,784
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	34,481,012	28,549,784
剰余金減少額又は欠損金増加額	141,292,965	258,903,850
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	141,292,965	258,903,850
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,095,866,705	2,053,284,622

(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24期	
	自 2023年7月12日	至 2024年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第23期	第24期
	2023年7月11日現在	2024年1月11日現在
1. 期首元本額	8,698,156,228円	8,145,089,705円
期中追加設定元本額	153,313,399円	108,201,861円
期中一部解約元本額	706,379,922円	1,005,962,085円
2. 受益権の総数	8,145,089,705口	7,247,329,481口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第23期	第24期
	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日	自 2023年7月12日 至 2024年1月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(50,562,569円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,853,194,448円)及び分配準備積立金(483,839,184円)より分配対象収益は2,387,596,201円(1万口当たり3,294.44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23期	第24期
	自 2023年1月12日 至 2023年7月11日	自 2023年7月12日 至 2024年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期 2023年7月11日現在	第24期 2024年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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23期 2023年7月11日現在	第24期 2024年1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	552,248,524	239,075,686
合計	552,248,524	239,075,686

(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23期 2023年7月11日現在	第24期 2024年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2573円 (12,573円)	1,2833円 (12,833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

2024年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	360,259,264	1,561,111,468	
	国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	1,177,222,514	1,470,704,086	
	D I A Mマネーマザーファンド	294,245,101	295,951,722	
	外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	99,618,178	779,721,441	
	外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	995,614,214	2,270,697,337	
	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	481,958,411	742,553,323	
	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	339,862,214	768,122,589	
親投資信託受益証券 合計		3,748,779,896	7,888,861,966	
合計			7,888,861,966	

(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)

2024年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,325,879,582
国債証券	449,985,136,950
地方債証券	29,572,914,057
特殊債券	28,942,313,821
社債券	23,776,995,600
未収利息	569,184,780
前払費用	187,561,923
流動資産合計	546,359,986,713
資産合計	546,359,986,713
負債の部	
流動負債	
未払解約金	11,150,481,000
流動負債合計	11,150,481,000
負債合計	11,150,481,000
純資産の部	
元本等	
元本	428,394,158,975
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	106,815,346,738
元本等合計	535,209,505,713
純資産合計	535,209,505,713
負債純資産合計	546,359,986,713

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7月12日 至 2024年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあつては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	451,050,455,847円
同期中追加設定元本額	351,769,216,167円
同期中一部解約元本額	374,425,513,039円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	26,323,195,736円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	56,606,049円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	87,780,257円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	47,232,489円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	786,337,358円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	271,566,704円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	40,551,374円
たわらノーロード 国内債券	19,133,000,602円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,390,841,248円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,531,285,370円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,956,223,656円
たわらノーロード バランス（積極型）	402,583,668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）	188,971,204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）	2,381,144,280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）	2,632,680,066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）	781,926,868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）	36,728,481円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	20,456,124円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	190,464,601円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	5,184,517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>	13,455,481,019円
O n eグローバルバランス	85,210,855円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	10,789,126,599円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	15,949,804,536円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	7,124,073,657円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,616,386,900円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,713,239,401円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	511,301,143円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	74,055,112円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,838,349,962円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,416,875円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	5,244,186,785円

D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,300,254,579円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	470,311,561円
投資のソムリエ	90,823,131,816円
クルーズコントロール	1,177,222,514円
投資のソムリエ<DC年金>	8,735,274,950円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,253,186,441円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,013,763,597円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,215,598,049円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	33,990,547,314円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	512,308,015円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	259,279,199円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	87,665,290円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,029,090,803円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,415,331,043円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,496,010,970円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,139,613,247円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	673,740,560円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	281,249,865円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	171,621,194円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,052,675,221円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	40,968,719円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	161,408,933円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,167,534,651円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,172,032,430円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,540,610,006円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	706,532,898円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,144,358,419円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	2,980,757,352円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,968,335,495円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,035,526,887円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	2,024,268,104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)	10,036,402,497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)	1,179,872,920円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,848,441,408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)	587,158,827円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	260,978,011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)	2,397,299,626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)	2,408,636,925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)	2,381,224,582円

インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,927,959,684円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	39,280,280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）	465,443,530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）	145,318,158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）	92,745,141円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	21,136,550円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	55,261,491円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	29,706,177円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	368,250円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	7,014,557円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	96,147,081円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2,671,243,954円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,093,866,159円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,262,166,282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）	57,201,783円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	129,853,208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）	1,579,643,015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）	102,060,284円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	561,767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）	1,550,657,363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）	29,788,301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）	271,448,835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）	474,252,724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）	784,664,877円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	202,682,917円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	58,249,238円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	387,569,601円
動的パッケージファンド<DC年金>	206,780,526円
コア資産形成ファンド	109,306,062円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	21,833,980,218円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	24,275,836,139円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	18,503,617,489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]	117,422,889円
計	428,394,158,975円
2. 受益権の総数	428,394,158,975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7月12日 至 2024年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	184,459,550	
地方債証券	187,451,893	
特殊債券	55,052,587	
社債券	147,605,800	
合計	574,569,830	

（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2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年1月11日現在

1口当たり純資産額	1,249,300円
(1万口当たり純資産額)	(12,493,000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

2024年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 4 6回 利付国庫債券 (2年)	1,500,000,000	1,501,260,000	
	4 4 7回 利付国庫債券 (2年)	1,000,000,000	1,000,850,000	
	4 4 8回 利付国庫債券 (2年)	2,000,000,000	2,001,540,000	
	4 4 9回 利付国庫債券 (2年)	1,800,000,000	1,801,242,000	
	4 5 1回 利付国庫債券 (2年)	12,500,000,000	12,509,625,000	
	4 5 5回 利付国庫債券 (2年)	2,400,000,000	2,400,672,000	
	1 4 3回 利付国庫債券 (5年)	3,700,000,000	3,707,215,000	
	1 4 5回 利付国庫債券 (5年)	7,300,000,000	7,315,987,000	
	1 4 6回 利付国庫債券 (5年)	4,700,000,000	4,710,434,000	
	1 4 7回 利付国庫債券 (5年)	5,750,000,000	5,751,207,500	
	1 4 8回 利付国庫債券 (5年)	3,610,000,000	3,610,433,200	
	1 4 9回 利付国庫債券 (5年)	1,680,000,000	1,680,000,000	
	1 5 0回 利付国庫債券 (5年)	1,470,000,000	1,469,559,000	
	1 5 1回 利付国庫債券 (5年)	1,900,000,000	1,898,784,000	
	1 5 2回 利付国庫債券 (5年)	1,890,000,000	1,894,498,200	
	1 5 3回 利付国庫債券 (5年)	5,210,000,000	5,202,810,200	
	1 5 4回 利付国庫債券 (5年)	1,400,000,000	1,401,792,000	
	1 5 5回 利付国庫債券 (5年)	6,200,000,000	6,251,026,000	
	1 5 6回 利付国庫債券 (5年)	4,300,000,000	4,318,533,000	
	1 5 7回 利付国庫債券 (5年)	4,400,000,000	4,414,652,000	

年)			
158回 利付国庫債券(5年)	3,600,000,000	3,596,976,000	
159回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,095,821,000	
160回 利付国庫債券(5年)	900,000,000	902,178,000	
161回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,711,220,000	
162回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,005,570,000	
163回 利付国庫債券(5年)	2,700,000,000	2,727,594,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	130,343,400	
2回 利付国庫債券(40年)	330,000,000	376,348,500	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	614,525,400	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	818,899,200	
5回 利付国庫債券(40年)	710,000,000	775,710,500	
6回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	1,005,095,000	
7回 利付国庫債券(40年)	880,000,000	896,992,800	
8回 利付国庫債券(40年)	990,000,000	935,183,700	
9回 利付国庫債券(40年)	1,890,000,000	1,306,840,500	
10回 利付国庫債券(40年)	1,930,000,000	1,564,265,000	
11回 利付国庫債券(40年)	1,040,000,000	808,776,800	
12回 利付国庫債券(40年)	1,420,000,000	982,143,000	
13回 利付国庫債券(40年)	2,090,000,000	1,430,375,100	
14回 利付国庫債券(40年)	2,100,000,000	1,532,517,000	
15回 利付国庫債券(40年)	2,340,000,000	1,880,190,000	
16回 利付国庫債券(40年)	1,200,000,000	1,054,860,000	
338回 利付国庫債券(10年)	3,230,000,000	3,247,765,000	
339回 利付国庫債券(10年)	3,980,000,000	4,005,153,600	
340回 利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,323,958,000	

3 4 1回 利付国庫債券（10年）	3,620,000,000	3,642,082,000	
3 4 2回 利付国庫債券（10年）	3,520,000,000	3,528,060,800	
3 4 3回 利付国庫債券（10年）	4,090,000,000	4,099,938,700	
3 4 4回 利付国庫債券（10年）	3,570,000,000	3,579,103,500	
3 4 5回 利付国庫債券（10年）	4,890,000,000	4,902,176,100	
3 4 6回 利付国庫債券（10年）	4,540,000,000	4,550,805,200	
3 4 7回 利付国庫債券（10年）	4,500,000,000	4,508,460,000	
3 4 8回 利付国庫債券（10年）	4,070,000,000	4,075,209,600	
3 4 9回 利付国庫債券（10年）	5,850,000,000	5,852,281,500	
3 5 0回 利付国庫債券（10年）	6,600,000,000	6,594,456,000	
3 5 1回 利付国庫債券（10年）	2,400,000,000	2,395,224,000	
3 5 2回 利付国庫債券（10年）	4,950,000,000	4,931,586,000	
3 5 3回 利付国庫債券（10年）	3,690,000,000	3,672,841,500	
3 5 4回 利付国庫債券（10年）	2,460,000,000	2,446,740,600	
3 5 5回 利付国庫債券（10年）	4,130,000,000	4,105,550,400	
3 5 6回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,682,531,000	
3 5 7回 利付国庫債券（10年）	5,800,000,000	5,755,804,000	
3 5 8回 利付国庫債券（10年）	5,150,000,000	5,104,474,000	
3 5 9回 利付国庫債券（10年）	4,050,000,000	4,007,677,500	
3 6 0回 利付国庫債券（10年）	3,500,000,000	3,456,355,000	
3 6 1回 利付国庫債券（10年）	6,000,000,000	5,912,400,000	
3 6 2回 利付国庫債券（10年）	4,210,000,000	4,137,672,200	
3 6 3回 利付国庫債券（10年）	5,070,000,000	4,969,107,000	
3 6 4回 利付国庫債券（10年）	5,350,000,000	5,228,341,000	
3 6 5回 利付国庫債券（10年）	5,430,000,000	5,292,458,100	
3 6 6回 利付国庫債券（10年）	4,880,000,000	4,783,668,800	

0年)			
367回 利付国庫債券(10年)	5,700,000,000	5,572,833,000	
368回 利付国庫債券(10年)	4,550,000,000	4,436,341,000	
369回 利付国庫債券(10年)	5,220,000,000	5,213,266,200	
370回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,486,185,000	
371回 利付国庫債券(10年)	5,200,000,000	5,125,432,000	
372回 利付国庫債券(10年)	5,200,000,000	5,309,772,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	126,083,100	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	113,102,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	235,162,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	230,724,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	276,282,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	263,030,300	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	170,251,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	399,690,400	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	308,815,000	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	285,511,200	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	318,897,000	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	468,808,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	328,302,800	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	394,597,500	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	364,039,200	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	347,428,700	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	419,667,500	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	388,485,900	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	737,862,000	

27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	746,343,600	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	927,287,900	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,024,690,000	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,035,575,200	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	836,589,600	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,140,089,500	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,330,674,200	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,386,756,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,190,676,800	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,535,879,600	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,500,732,800	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	921,621,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,330,891,100	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,114,212,800	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,127,129,800	
42回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,062,250,000	
43回 利付国庫債券(30年)	1,410,000,000	1,496,221,500	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,197,822,600	
45回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,176,231,500	
46回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	1,909,905,800	
47回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,391,067,400	
48回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,718,555,200	
49回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,296,724,000	
50回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,014,311,500	
51回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,190,813,600	
52回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,228,410,000	

年)			
5 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 220, 000, 000	1, 018, 712, 200	
5 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 790, 000, 000	1, 559, 698, 600	
5 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 080, 000, 000	938, 325, 600	
5 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 040, 000, 000	900, 952, 000	
5 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 730, 000, 000	1, 494, 322, 100	
5 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 660, 000, 000	1, 429, 675, 000	
5 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 120, 000, 000	937, 977, 600	
6 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 430, 000, 000	1, 251, 736, 200	
6 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 060, 000, 000	880, 531, 400	
6 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	720, 000, 000	565, 646, 400	
6 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 100, 000, 000	837, 144, 000	
6 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 300, 000, 000	985, 491, 000	
6 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 300, 000, 000	982, 527, 000	
6 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 090, 000, 000	819, 887, 100	
6 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 270, 000, 000	1, 006, 017, 800	
6 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 340, 000, 000	1, 057, 742, 400	
6 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 360, 000, 000	1, 100, 580, 000	
7 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 200, 000, 000	967, 896, 000	
7 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 180, 000, 000	948, 578, 400	
7 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 290, 000, 000	1, 034, 476, 800	
7 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 390, 000, 000	1, 111, 972, 200	
7 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 390, 000, 000	1, 203, 448, 100	
7 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 320, 000, 000	1, 230, 570, 000	
7 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 320, 000, 000	1, 259, 412, 000	
7 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1, 600, 000, 000	1, 600, 000, 000	

78回 利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,714,734,000	
79回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,448,736,000	
80回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,775,565,000	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	184,615,200	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	71,628,900	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,978,000	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	256,965,000	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,465,000	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	92,765,700	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	413,708,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	145,034,400	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	72,867,900	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	176,636,800	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	617,116,400	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	126,039,600	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	125,778,000	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	623,045,900	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,535,800	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	497,720,600	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	116,783,700	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,230,992,000	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	393,243,400	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	714,220,000	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	592,542,500	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	128,458,800	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	711,836,400	

年)			
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	171,977,600	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	809,295,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	902,044,000	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	251,879,900	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	549,810,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	175,233,600	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	119,504,000	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	697,280,000	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	547,075,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	656,208,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	747,891,000	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	380,621,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	483,010,000	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	509,468,400	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	815,598,400	
113回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,515,946,100	
114回 利付国庫債券(20年)	410,000,000	455,169,700	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	401,770,800	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	593,653,000	
117回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	523,584,700	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	616,510,650	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	515,975,400	
121回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	708,294,400	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	627,079,800	
123回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	392,945,000	

1 2 5回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	678,966,000	
1 2 6回 利付国庫債券 (20年)	510,000,000	569,960,700	
1 2 7回 利付国庫債券 (20年)	540,000,000	599,697,000	
1 2 8回 利付国庫債券 (20年)	370,000,000	411,410,400	
1 3 0回 利付国庫債券 (20年)	910,000,000	1,006,141,500	
1 3 2回 利付国庫債券 (20年)	30,000,000	32,987,400	
1 3 3回 利付国庫債券 (20年)	630,000,000	697,580,100	
1 3 4回 利付国庫債券 (20年)	200,000,000	221,748,000	
1 3 5回 利付国庫債券 (20年)	130,000,000	143,107,900	
1 3 6回 利付国庫債券 (20年)	360,000,000	393,451,200	
1 3 7回 利付国庫債券 (20年)	480,000,000	528,758,400	
1 3 8回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,150,449,800	
1 3 9回 利付国庫債券 (20年)	980,000,000	1,071,590,800	
1 4 0回 利付国庫債券 (20年)	850,000,000	937,261,000	
1 4 1回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,169,816,000	
1 4 2回 利付国庫債券 (20年)	430,000,000	478,228,800	
1 4 3回 利付国庫債券 (20年)	1,230,000,000	1,347,022,200	
1 4 4回 利付国庫債券 (20年)	750,000,000	814,777,500	
1 4 5回 利付国庫債券 (20年)	2,250,000,000	2,486,542,500	
1 4 6回 利付国庫債券 (20年)	2,240,000,000	2,476,924,800	
1 4 7回 利付国庫債券 (20年)	1,290,000,000	1,414,278,600	
1 4 8回 利付国庫債券 (20年)	2,730,000,000	2,967,209,700	
1 4 9回 利付国庫債券 (20年)	2,290,000,000	2,488,726,200	
1 5 0回 利付国庫債券 (20年)	2,930,000,000	3,152,738,600	
1 5 1回 利付国庫債券 (20年)	3,160,000,000	3,332,346,400	
1 5 2回 利付国庫債券 (20年)	2,440,000,000	2,570,515,600	

0年)			
153回 利付国庫債券 (20年)	2,740,000,000	2,912,510,400	
154回 利付国庫債券 (20年)	3,020,000,000	3,172,842,200	
155回 利付国庫債券 (20年)	2,280,000,000	2,339,872,800	
156回 利付国庫債券 (20年)	2,280,000,000	2,176,328,400	
157回 利付国庫債券 (20年)	2,580,000,000	2,392,717,800	
158回 利付国庫債券 (20年)	2,140,000,000	2,054,207,400	
159回 利付国庫債券 (20年)	1,840,000,000	1,783,254,400	
160回 利付国庫債券 (20年)	1,820,000,000	1,781,288,600	
161回 利付国庫債券 (20年)	1,760,000,000	1,694,668,800	
162回 利付国庫債券 (20年)	1,930,000,000	1,852,664,900	
163回 利付国庫債券 (20年)	2,430,000,000	2,323,881,900	
164回 利付国庫債券 (20年)	2,750,000,000	2,584,010,000	
165回 利付国庫債券 (20年)	2,250,000,000	2,106,742,500	
166回 利付国庫債券 (20年)	1,240,000,000	1,190,065,200	
167回 利付国庫債券 (20年)	2,350,000,000	2,181,693,000	
168回 利付国庫債券 (20年)	1,590,000,000	1,448,013,000	
169回 利付国庫債券 (20年)	1,520,000,000	1,355,961,600	
170回 利付国庫債券 (20年)	1,900,000,000	1,687,599,000	
171回 利付国庫債券 (20年)	1,740,000,000	1,537,690,200	
172回 利付国庫債券 (20年)	1,080,000,000	966,178,800	
173回 利付国庫債券 (20年)	2,360,000,000	2,100,801,200	
174回 利付国庫債券 (20年)	2,400,000,000	2,125,656,000	
175回 利付国庫債券 (20年)	2,020,000,000	1,810,768,400	
176回 利付国庫債券 (20年)	2,500,000,000	2,230,025,000	
177回 利付国庫債券 (20年)	1,750,000,000	1,527,207,500	

	178回 利付国庫債券(20年)	2,800,000,000	2,477,860,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	1,938,354,000	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,520,000,000	2,334,679,200	
	181回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,785,639,000	
	182回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	2,086,897,500	
	183回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,731,093,000	
	184回 利付国庫債券(20年)	1,880,000,000	1,815,290,400	
	185回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,022,279,000	
	186回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,750,541,000	
国債証券 合計		456,285,000,000	449,985,136,950	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,799,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	109,802,000	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	196,652,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	394,176,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	294,735,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	227,816,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	110,420,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,442,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	103,498,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	211,292,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	317,739,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,658,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	110,767,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	208,940,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,852,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	399,152,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	397,556,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	97,723,000	
	36回2号 宮城県公募公債	250,000,000	245,170,000	

10年			
213回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,578,000	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	198,298,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	196,224,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	292,524,000	
3回 神奈川県公募公債 3 0年	100,000,000	119,741,000	
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	109,495,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	333,870,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	109,857,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,696,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,134,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	194,638,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	195,338,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	194,450,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	193,420,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	290,031,000	
10回 大阪府公募公債 2 0年	200,000,000	218,232,000	
13回 大阪府公募公債 2 0年	100,000,000	103,435,000	
14回 大阪府公募公債 2 0年	100,000,000	94,923,000	
190回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	298,773,000	
29年度13回 京都府公募 公債	109,330,000	109,190,057	
令和2年度1回 京都府公募 公債	400,000,000	394,124,000	
令和2年度14回 京都府公 募公債	200,000,000	196,512,000	
26年度17回 兵庫県公募 公債	200,000,000	200,908,000	
令和元年度16回 兵庫県公 募公債	200,000,000	196,546,000	
令和3年度2回 兵庫県公募 公債	100,000,000	97,783,000	
2回 兵庫県公募公債 30 年	100,000,000	116,147,000	

1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	207,772,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	313,527,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	103,622,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	101,790,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	196,764,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	98,179,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	195,404,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	104,276,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	104,710,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	205,470,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	103,532,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	328,191,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	333,495,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	111,870,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	215,302,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	151,926,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,707,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	197,798,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	219,966,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	99,810,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	196,434,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	84,404,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	88,048,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	197,330,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	176,484,000	
12回 埼玉県公募公債 3	300,000,000	224,676,000	

0年			
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	111,062,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	108,356,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	323,184,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	103,524,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	100,326,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	198,928,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	196,730,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	98,102,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	104,353,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	149,170,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	108,490,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	111,213,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	325,476,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	201,618,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,965,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	193,646,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	104,198,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	103,122,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	93,593,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	195,928,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	107,533,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,012,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	603,984,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,670,000	
150回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,172,000	
153回 共同発行市場公募	100,000,000	100,719,000	

地方債			
157回 共同発行市場公募 地方債	120,000,000	119,916,000	
159回 共同発行市場公募 地方債	200,000,000	199,780,000	
160回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	499,200,000	
166回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	500,755,000	
169回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	500,975,000	
173回 共同発行市場公募 地方債	400,000,000	400,644,000	
174回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,870,000	
178回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	100,078,000	
179回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	500,290,000	
189回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,512,000	
194回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	296,442,000	
196回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	492,450,000	
203回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	98,379,000	
227回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	487,555,000	
228回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	485,290,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	99,392,000	
令和2年度1回 福島県公募 公債	200,000,000	195,982,000	
29年度4回 大阪市公募公 債	200,000,000	199,778,000	
令和2年 2回 大阪市公募 公債	300,000,000	295,269,000	
6回 大阪市公募公債 20 年	200,000,000	218,536,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	196,412,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	107,434,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	103,774,000	
4回 京都市公募公債 20 年	100,000,000	106,381,000	
9回 京都市公募公債 20 年	200,000,000	223,122,000	
24年度12回 神戸市公募	200,000,000	218,460,000	

公債			
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	299,430,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	156,602,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	393,336,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	117,585,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	108,587,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	107,537,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	111,746,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	283,221,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	198,982,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	219,882,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	111,538,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	108,340,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	332,991,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	107,437,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	114,974,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	188,422,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	87,230,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,429,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	189,558,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	300,051,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	94,624,000	
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	298,779,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	197,202,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	195,982,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	198,156,000	
地方債証券 合計	29,439,330,000	29,572,914,057	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	207,546,000

1 2 回 新関西国際空港社債	200,000,000	206,616,000	
7 8 回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,192,000	
1 2 5 回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	433,745,000	
1 2 7 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,850,000	
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	78,892,000	
1 5 6 回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	388,364,000	
3 3 回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,601,000	
1 回 高速道路機構債	300,000,000	374,580,000	
1 9 回 高速道路機構債	150,000,000	180,810,000	
2 6 回 高速道路機構債	200,000,000	238,274,000	
3 6 回 高速道路機構債	300,000,000	366,948,000	
5 0 回 高速道路機構債	300,000,000	267,522,000	
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,111,000	
1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,958,000	
1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,938,000	
1 5 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,921,000	
1 6 2 回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,212,000	
1 6 9 回 高速道路機構債	100,000,000	93,220,000	
1 7 2 回 高速道路機構債	200,000,000	182,852,000	
2 1 0 回 高速道路機構債	100,000,000	93,413,000	
9 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,409,000	
1 1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,988,000	
1 2 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	546,600,000	
1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,817,000	
1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,656,000	
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,578,000	
2 4 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	502,615,000	
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,639,000	
2 5 4 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,636,000	
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	196,240,000	

第262回 政保道路債	500,000,000	512,310,000	
268回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	95,873,000	
271回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	300,000,000	299,595,000	
286回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	185,060,000	
300回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	100,045,000	
309回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	800,000,000	800,656,000	
319回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	200,000,000	190,490,000	
337回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	94,039,000	
398回 政保道路債	300,000,000	223,485,000	
413回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	141,850,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	154,130,000	
420回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	156,042,000	
28回 日本道路・機構承継 債	500,000,000	595,285,000	
1回 地方公共団体金融機構 債券 20年	200,000,000	216,542,000	
1回 地方公共団体金融機構 債券 20年	300,000,000	330,354,000	
2回 地方公共団体金融機構 債券 20年	300,000,000	331,140,000	
13回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	111,063,000	
79回 政保地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	311,250,000	
19回 地方公共団体金融機 構債券	200,000,000	218,908,000	
23回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	108,325,000	
24回 地方公共団体金融機 構債券 20年	200,000,000	217,060,000	
F147回 地方公共団体金 融機構債券	200,000,000	207,032,000	
F174回 地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	329,517,000	
36回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	107,183,000	
39回 地方公共団体金融機 構債券	500,000,000	528,260,000	
42回 地方公共団体金融機 構債券 20年	300,000,000	303,159,000	
71回 政保地方公共団体金 融機構債券	100,000,000	100,464,000	

44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	207,956,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,777,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,400,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,970,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	95,002,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,080,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,087,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,942,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,783,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	255,777,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	226,101,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,780,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	218,648,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,874,340	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	103,766,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	103,818,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	205,856,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	158,100,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	105,236,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	100,512,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	219,588,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,254,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	387,667,000	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,819,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,297,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,574,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	269,232,500	
159回 住宅金融支援機構	100,000,000	102,061,000	

債券			
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,672,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,851,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,502,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,748,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	92,483,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,925,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,925,000	
40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,104,000	40,243,962	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,620,000	15,193,981	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,240,000	96,906,421	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,952,000	144,801,879	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,594,000	20,364,632	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,838,000	17,470,098	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,712,000	20,383,390	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,700,000	21,404,421	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,315,000	26,122,801	
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,388,000	63,899,037	
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,102,000	28,866,374	
82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,428,000	34,981,946	
84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,999,000	35,565,633	
86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,719,000	39,263,389	
90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,092,000	40,358,210	
93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,452,000	44,931,574	
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,168,000	50,940,302	
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,028,000	53,104,360	

1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	201,015,000	193,748,307	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,188,000	66,068,716	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,697,000	65,681,660	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,085,000	65,989,343	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	212,925,000	205,255,441	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	212,475,000	204,704,789	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,020,000	139,668,762	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	217,236,000	208,700,797	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	215,403,000	207,013,053	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	375,415,000	361,821,222	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,797,000	72,024,275	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,196,000	73,485,188	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,324,000	236,030,044	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	332,308,000	315,496,538	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	255,960,000	242,982,828	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	261,657,000	248,503,502	
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	797,535,000	756,087,106	
6 回 沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	411,088,000	
2 1 回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,727,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	99,872,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	298,833,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	298,500,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	198,976,000	
3 6 9 回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	399,420,000	
3 7 7 回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	299,037,000	
1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	108,548,000	
7 2 回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,182,000	
7 7 回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,897,000	
8 5 回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,487,000	
8 7 回 中日本高速道路債券	400,000,000	398,860,000	

	78回 鉄道建設・運輸施設 整備支援機構債券	100,000,000	102,205,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設 整備支援機構債券	200,000,000	194,694,000	
特殊債券	合計	28,861,687,000	28,942,313,821	
社債券	25回 フランス相互信用連 合銀行（BF C M）円貨社債 （2017）	300,000,000	295,497,000	
	11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債（2 016）	100,000,000	99,158,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	399,072,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	86,590,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,793,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,170,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	298,944,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,296,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	199,276,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	497,860,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	100,649,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	300,564,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	200,738,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	498,120,000	
	62回 西日本高速道路債券	500,000,000	497,860,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	199,014,000	
	10回 キリンホールディン グス社債	100,000,000	100,493,000	
	3回 ダイドーグループHD 社債	300,000,000	294,615,000	
	9回 野村不動産ホールディ ングス社債	100,000,000	94,903,000	
	12回 セブン&アイ・ホー ルディングス社債	100,000,000	100,811,000	
	14回 セブン&アイ・ホー ルディングス社債	200,000,000	199,752,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	299,688,000	
	42回 王子ホールディング ス社債	200,000,000	198,982,000	
	23回 三菱ケミカルホール ディングス社債	200,000,000	185,020,000	
	40回 三菱ケミカルホール ディングス社債	100,000,000	99,412,000	
	17回 ダイセル社債	300,000,000	293,154,000	
	16回 武田薬品工業社債	500,000,000	475,410,000	
	4回 ENEOSホールディ ングス社債	300,000,000	294,363,000	
	14回 プリヂストン社債	300,000,000	296,910,000	
	35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	298,305,000	
	17回 パナソニック社債	100,000,000	100,221,000	
	19回 パナソニック社債	100,000,000	97,050,000	

23回	パナソニック社債	200,000,000	192,212,000	
58回	川崎重工業社債	300,000,000	286,878,000	
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	99,337,000	
26回	トヨタ自動車社債	200,000,000	199,128,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	91,868,000	
73回	三井物産社債	400,000,000	393,012,000	
12回	新生銀行社債	400,000,000	399,020,000	
88回	三菱東京UFJ銀行 社債	100,000,000	106,383,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,775,000	
20回	三井住友信託銀行社 債	300,000,000	298,173,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	298,425,000	
17回	NTTファイナンス 社債	300,000,000	298,509,000	
18回	NTTファイナンス 社債	400,000,000	391,828,000	
69回	ホンダファイナンス 社債	300,000,000	298,494,000	
81回	トヨタファイナンス 社債	100,000,000	99,658,000	
96回	トヨタファイナンス 社債	100,000,000	99,549,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	194,894,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	290,508,000	
23回	三井住友ファイナン ス&リース社債	100,000,000	98,374,000	
27回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	199,144,000	
29回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	199,688,000	
31回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	194,514,000	
56回	三菱UFJリース社 債	300,000,000	299,022,000	
3回	野村ホールディングス 社債	300,000,000	297,291,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	100,158,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	200,100,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	103,575,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	89,261,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	308,007,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	206,410,000	
65回	東日本旅客鉄道普通 社債	100,000,000	109,293,000	
71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,348,000	
73回	東日本旅客鉄道普通 社債	200,000,000	219,368,000	
107回	東日本旅客鉄道普 通社債	100,000,000	94,070,000	

1 2 5回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,196,000	
1 2 7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	92,042,000	
1 4 7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,972,000	
1 6 0回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	70,365,000	
1 6 3回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,647,000	
1 6 5回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	171,122,000	
1 7 1回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	150,240,000	
2 1回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,779,000	
6 0回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	195,716,000	
7 0回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	76,646,000	
7 1回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	70,780,000	
7 4回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,546,000	
7 5回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	170,608,000	
3 2回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,162,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	126,171,600	
4 7回 東京地下鉄社債	100,000,000	69,044,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	292,530,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	195,440,000	
1 2回 ソフトバンク社債	400,000,000	391,608,000	
3 0回 光通信社債	200,000,000	188,226,000	
5 2 7回 中部電力社債	100,000,000	90,891,000	
5 3 2回 中部電力社債	200,000,000	195,628,000	
4 9 7回 関西電力社債	100,000,000	101,021,000	
5 0 8回 関西電力社債	300,000,000	300,291,000	
5 3 0回 関西電力社債	400,000,000	394,132,000	
5 3 1回 関西電力社債	200,000,000	171,434,000	
5 4 1回 関西電力社債	300,000,000	286,836,000	
3 9 6回 中国電力社債	200,000,000	193,670,000	
4 2 5回 中国電力社債	100,000,000	97,514,000	
3 0 7回 北陸電力社債	100,000,000	101,788,000	
3 1 1回 北陸電力社債	100,000,000	101,426,000	
4 8 8回 東北電力社債	100,000,000	99,807,000	
5 2 1回 東北電力社債	400,000,000	392,236,000	
5 2 5回 東北電力社債	200,000,000	198,162,000	
5 3 6回 東北電力社債	300,000,000	285,399,000	
3 2 0回 四国電力社債	300,000,000	289,725,000	
4 6 3回 九州電力社債	100,000,000	89,063,000	
4 6 6回 九州電力社債	100,000,000	87,979,000	
4 9 1回 九州電力社債	300,000,000	288,420,000	
4 9 2回 九州電力社債	100,000,000	82,357,000	
4 9 3回 九州電力社債	200,000,000	198,918,000	
5 0 7回 九州電力社債	200,000,000	194,074,000	
3 4 0回 北海道電力社債	300,000,000	300,630,000	

	350回 北海道電力社債	200,000,000	177,364,000	
	13回 電源開発社債	200,000,000	205,130,000	
	54回 電源開発社債	100,000,000	99,647,000	
	75回 電源開発社債	200,000,000	190,932,000	
	41回 東京瓦斯社債	200,000,000	184,816,000	
	52回 東京瓦斯社債	100,000,000	87,349,000	
	55回 東京瓦斯社債	100,000,000	83,940,000	
	57回 東京瓦斯社債	300,000,000	198,666,000	
	7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,334,000	
	8回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	184,612,000	
社債券	合計	24,520,000,000	23,776,995,600	
	合計		532,277,360,428	

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)

2024年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	28,097,109,910
株式	501,152,764,250
派生商品評価勘定	1,429,566,430
未収入金	61,619,540
未収配当金	687,467,511
差入委託証拠金	1,374,581,790
流動資産合計	532,803,109,431
資産合計	532,803,109,431
負債の部	
流動負債	
前受金	932,237,300
未払解約金	1,646,755,000
流動負債合計	2,578,992,300
負債合計	2,578,992,300
純資産の部	
元本等	
元本	122,361,611,329
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	407,862,505,802
元本等合計	530,224,117,131
純資産合計	530,224,117,131
負債純資産合計	532,803,109,431

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7月12日 至 2024年1月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	110,812,327,700円
同期中追加設定元本額	34,049,017,796円
同期中一部解約元本額	22,499,734,167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	2,473,484,233円
たわらノーロード 国内株式くらっ専用	3,251,710,364円
One DC 国内株式インデックスファンド	30,128,161,090円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,578,155,640円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	9,370,446円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	21,489,905円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,851,349円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	18,230,649円
たわらノーロード TOPIX	2,142,968,356円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス (堅実型)	50,616,376円
たわらノーロード バランス (標準型)	371,245,453円
たわらノーロード バランス (積極型)	626,205,996円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	2,443,029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)	150,046,225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)	426,397,837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)	360,214,784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)	491,049,787円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	392,260円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,449,190円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	29,609,493円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,163,607円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,723,802円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,283,833,810円
O n eグローバルバランス	38,892,141円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	937,705,041円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,369,839,529円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,882,880,690円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	302,608,796円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	977,799,372円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,099,113,897円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,077,856,603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)	291,662,409円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	335,914,476円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	572,339,121円
投資のソムリエ	9,225,448,791円
クルーズコントロール	360,259,264円
投資のソムリエ<DC年金>	887,270,886円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	331,013,661円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,096,253,235円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	998,753,074円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,327,239,537円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	72,861,156円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	36,827,874円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	8,539,322円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	174,490,658円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	510,337,113円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,087,458,516円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	245,681,956円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	82,849,615円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	40,123,918円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	24,412,885円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	501,693,064円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,849,945円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,725,706円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	34,141,936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)	462,010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)	380,918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)	2,512,957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)	260,838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)	347,544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)	854,586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)	183,424,088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)	268,115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）	115,794,474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）	390,113,412円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	288,392,944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）	15,058,662円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	23,908,469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）	32,239,836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）	616,887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）	3,912,053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）	36,475,117円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	69,881,100円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,726,404円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	11,128,260円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,576,905円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	83,214円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,407,965円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	19,298,214円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	301,801,170円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	420,310,830円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,283,661,090円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	11,479,024円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	15,644,932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）	158,219,192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）	30,740,567円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	56,133円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	175,102,930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）	8,974,818円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	40,798,723円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	107,113,442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）	141,755,804円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	18,506,740円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	7,518,073円
動的パッケージファンド<DC年金>	28,430,300円
コア資産形成ファンド	15,497,741円
MHAMトピックスファンド	790,301,108円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	44,692,487円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,260,862,552円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,894,014,980円
計	122,361,611,329円
2. 受益権の総数	122,361,611,329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7月12日 至 2024年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2024年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	88,346,622,926
合計	88,346,622,926

(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2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年1月11日現在			
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	26,971,022,700	—	28,400,965,000	1,429,942,300
合計	26,971,022,700	—	28,400,965,000	1,429,942,300

(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)

2024年1月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.3333円 (43,333円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	7,600	3,890.00	29,564,000	
ニッセイ	199,400	797.00	158,921,800	
マルハニチロ	29,600	2,833.00	83,856,800	
雪国まいたけ	17,000	946.00	16,082,000	
カネコ種苗	6,100	1,400.00	8,540,000	
サカタのタネ	22,700	4,040.00	91,708,000	
ホクト	16,000	1,765.00	28,240,000	
ホクリヨウ	1,800	1,056.00	1,900,800	
ショーボンドホールディングス	27,200	6,702.00	182,294,400	
ミライト・ワン	65,900	1,931.50	127,285,850	
タマホーム	12,600	4,175.00	52,605,000	
サンヨーホームズ	1,400	748.00	1,047,200	
日本アクア	4,700	952.00	4,474,400	
ファーストコーポレーション	2,800	751.00	2,102,800	
ベステラ	2,600	1,076.00	2,797,600	
Robot Home	38,800	175.00	6,790,000	

キャンディール	2,000	587.00	1,174,000
住石ホールディングス	19,700	1,260.00	24,822,000
日鉄鉱業	8,000	5,400.00	43,200,000
三井松島ホールディングス	11,800	2,867.00	33,830,600
I N P E X	737,600	1,957.50	1,443,852,000
石油資源開発	23,100	5,540.00	127,974,000
K&Oエナジーグループ	9,100	2,287.00	20,811,700
ダイセキ環境ソリューション	2,200	1,151.00	2,532,200
第一カッター興業	5,200	1,358.00	7,061,600
明豊ファシリティワークス	4,200	852.00	3,578,400
安藤・間	115,500	1,202.00	138,831,000
東急建設	62,500	834.00	52,125,000
コムシスホールディングス	63,700	3,271.00	208,362,700
ビーアールホールディングス	29,400	368.00	10,819,200
高松コンストラクショングループ	14,700	2,904.00	42,688,800
東建コーポレーション	5,700	9,050.00	51,585,000
ソネック	1,200	955.00	1,146,000
ヤマウラ	10,200	1,576.00	16,075,200
オリエンタル白石	73,800	356.00	26,272,800
大成建設	130,600	5,229.00	682,907,400
大林組	499,000	1,299.00	648,201,000
清水建設	395,600	998.50	395,006,600
飛島建設	14,300	1,466.00	20,963,800
長谷工コーポレーション	128,000	1,959.00	250,752,000
松井建設	13,100	872.00	11,423,200
銭高組	1,100	4,495.00	4,944,500
鹿島建設	309,400	2,522.00	780,306,800
不動テトラ	9,700	2,375.00	23,037,500
大末建設	3,200	1,402.00	4,486,400
鉄建建設	10,100	2,048.00	20,684,800
西松建設	26,600	4,087.00	108,714,200
三井住友建設	103,800	406.00	42,142,800
大豊建設	4,900	3,745.00	18,350,500
佐田建設	5,000	643.00	3,215,000
ナカノフドー建設	5,600	520.00	2,912,000
奥村組	22,600	4,845.00	109,497,000
東鉄工業	17,300	3,130.00	54,149,000
イチケン	2,000	2,345.00	4,690,000
富士ピー・エス	3,600	468.00	1,684,800
浅沼組	10,400	4,105.00	42,692,000
戸田建設	188,800	944.40	178,302,720
熊谷組	23,400	3,695.00	86,463,000
北野建設	1,500	3,180.00	4,770,000
植木組	2,200	1,607.00	3,535,400
矢作建設工業	19,000	1,413.00	26,847,000
ピーエス三菱	17,800	925.00	16,465,000
日本ハウスホールディングス	29,800	303.00	9,029,400
大東建託	51,400	16,305.00	838,077,000
新日本建設	19,600	1,186.00	23,245,600
東亜道路工業	5,600	7,020.00	39,312,000

日本道路	16,400	2,072.00	33,980,800
東亜建設工業	10,800	3,840.00	41,472,000
日本国土開発	39,800	626.00	24,914,800
若築建設	4,900	3,080.00	15,092,000
東洋建設	35,200	1,255.00	44,176,000
五洋建設	197,700	836.60	165,395,820
世紀東急工業	18,000	1,785.00	32,130,000
福田組	5,300	5,530.00	29,309,000
日本ドライケミカル	1,900	2,957.00	5,618,300
住友林業	120,500	4,361.00	525,500,500
日本基礎技術	4,800	488.00	2,342,400
巴コーポレーション	9,900	572.00	5,662,800
大和ハウス工業	385,800	4,655.00	1,795,899,000
ライト工業	28,800	2,158.00	62,150,400
積水ハウス	423,200	3,316.00	1,403,331,200
日特建設	13,400	1,187.00	15,905,800
北陸電気工事	9,700	1,228.00	11,911,600
ユアテック	30,700	1,118.00	34,322,600
日本リーテック	10,900	1,229.00	13,396,100
四電工	5,800	3,310.00	19,198,000
中電工	21,700	2,713.00	58,872,100
関電工	87,400	1,408.00	123,059,200
きんでん	98,200	2,425.00	238,135,000
東京エネシス	13,800	1,046.00	14,434,800
トーエネック	4,700	4,685.00	22,019,500
住友電設	13,300	2,793.00	37,146,900
日本電設工業	26,200	2,004.00	52,504,800
エクシオグループ	68,200	3,234.00	220,558,800
新日本空調	9,100	2,473.00	22,504,300
九電工	30,200	5,203.00	157,130,600
三機工業	30,200	1,836.00	55,447,200
日揮ホールディングス	138,100	1,746.50	241,191,650
中外炉工業	4,600	2,465.00	11,339,000
ヤマト	6,400	963.00	6,163,200
太平電業	8,600	4,435.00	38,141,000
高砂熱学工業	37,400	3,230.00	120,802,000
三晃金属工業	1,000	4,730.00	4,730,000
NEC ネットエスアイ	55,500	2,363.00	131,146,500
朝日工業社	6,500	3,020.00	19,630,000
明星工業	27,100	1,094.00	29,647,400
大気社	16,100	4,215.00	67,861,500
ダイダン	18,400	1,483.00	27,287,200
日比谷総合設備	10,200	2,583.00	26,346,600
ニッポン	41,900	2,265.00	94,903,500
日清製粉グループ本社	129,500	2,029.50	262,820,250
日東富士製粉	2,300	4,955.00	11,396,500
昭和産業	13,500	3,240.00	43,740,000
鳥越製粉	7,000	656.00	4,592,000
中部飼料	19,300	1,105.00	21,326,500
フィード・ワン	20,500	841.00	17,240,500

東洋精糖	1,500	2,127.00	3,190,500
日本甜菜製糖	8,100	2,028.00	16,426,800
DM三井製糖ホールディングス	13,800	3,150.00	43,470,000
塩水港精糖	10,300	239.00	2,461,700
ウェルネオシュガー	7,000	2,216.00	15,512,000
L I F U L L	49,900	190.00	9,481,000
M I X I	31,300	2,483.00	77,717,900
ジェイエイシーリクルートメント	52,800	664.00	35,059,200
日本M&Aセンターホールディングス	233,000	785.20	182,951,600
メンバーズ	5,000	1,081.00	5,405,000
中広	1,000	418.00	418,000
UTグループ	18,800	2,349.00	44,161,200
アイティメディア	5,600	1,016.00	5,689,600
ケアネット	22,400	910.00	20,384,000
E・Jホールディングス	8,500	1,673.00	14,220,500
オープンアップグループ	43,800	2,325.00	101,835,000
コシダカホールディングス	43,700	1,080.00	47,196,000
アルトナー	3,400	2,371.00	8,061,400
パソナグループ	17,800	2,532.00	45,069,600
C D S	2,000	1,709.00	3,418,000
リンクアンドモチベーション	42,100	549.00	23,112,900
エス・エム・エス	51,300	2,876.00	147,538,800
サニーサイドアップグループ	2,400	571.00	1,370,400
パーソルホールディングス	1,488,600	244.50	363,962,700
リニカル	5,300	537.00	2,846,100
クックパッド	40,200	119.00	4,783,800
エスクリ	3,300	298.00	983,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,000	693.00	2,772,000
森永製菓	60,000	2,692.50	161,550,000
中村屋	3,500	3,095.00	10,832,500
江崎グリコ	40,100	4,375.00	175,437,500
名糖産業	5,500	1,701.00	9,355,500
井村屋グループ	8,300	2,396.00	19,886,800
不二家	9,700	2,471.00	23,968,700
山崎製パン	93,700	3,455.00	323,733,500
第一屋製パン	1,500	675.00	1,012,500
モロゾフ	4,600	3,850.00	17,710,000
亀田製菓	8,000	4,110.00	32,880,000
寿スピリッツ	66,200	2,148.50	142,230,700
カルビー	64,100	2,961.50	189,832,150
森永乳業	48,900	2,875.00	140,587,500
六甲バター	10,400	1,344.00	13,977,600
ヤクルト本社	200,100	3,318.00	663,931,800
明治ホールディングス	171,800	3,495.00	600,441,000
雪印メグミルク	33,900	2,218.00	75,190,200
プリマハム	18,800	2,334.00	43,879,200
日本ハム	60,200	4,886.00	294,137,200
林兼産業	2,600	566.00	1,471,600
丸大食品	14,000	1,644.00	23,016,000
S F o o d s	15,500	3,420.00	53,010,000

柿安本店	5,500	2,566.00	14,113,000
伊藤ハム米久ホールディングス	21,500	4,060.00	87,290,000
学情	7,400	1,735.00	12,839,000
スタジオアリス	7,300	2,121.00	15,483,300
クロスキャット	9,100	1,106.00	10,064,600
エプロ	2,300	905.00	2,081,500
システナ	215,800	312.00	67,329,600
N J S	3,200	2,771.00	8,867,200
デジタルアーツ	8,900	5,150.00	45,835,000
日鉄ソリューションズ	24,300	4,800.00	116,640,000
総合警備保障	244,400	840.20	205,344,880
キューブシステム	7,600	1,123.00	8,534,800
いちご	161,300	339.00	54,680,700
日本駐車場開発	148,200	191.00	28,306,200
コア	6,300	1,821.00	11,472,300
カカクコム	96,500	1,747.00	168,585,500
アイロムグループ	5,900	2,010.00	11,859,000
セントケア・ホールディング	10,700	1,003.00	10,732,100
サイネックス	1,400	816.00	1,142,400
ルネサンス	11,300	907.00	10,249,100
ディップ	22,400	3,235.00	72,464,000
S B Sホールディングス	12,700	2,554.00	32,435,800
デジタルホールディングス	7,600	1,274.00	9,682,400
新日本科学	13,300	1,870.00	24,871,000
キャリアデザインセンター	1,700	2,094.00	3,559,800
ベネフィット・ワン	50,800	2,114.00	107,391,200
エムスリー	289,000	2,392.00	691,288,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,300	384.00	2,035,200
プラス	900	700.00	630,000
アウトソーシング	93,800	1,740.00	163,212,000
ウェルネット	6,100	575.00	3,507,500
ワールドホールディングス	6,500	2,891.00	18,791,500
ディー・エヌ・エー	52,000	1,551.50	80,678,000
博報堂DYホールディングス	186,500	1,160.00	216,340,000
ぐるなび	27,300	270.00	7,371,000
タカミヤ	19,800	501.00	9,919,800
ファンコミュニケーションズ	20,500	404.00	8,282,000
ライク	5,400	1,504.00	8,121,600
A o b a - B B T	3,100	411.00	1,274,100
エスプール	42,000	438.00	18,396,000
WDBホールディングス	7,500	2,269.00	17,017,500
手間いらず	2,400	2,895.00	6,948,000
ティア	4,800	468.00	2,246,400
C D G	900	1,225.00	1,102,500
アドウェイズ	20,000	513.00	10,260,000
バリューコマース	12,900	1,416.00	18,266,400
インフォマート	151,800	462.00	70,131,600
サッポロホールディングス	46,100	6,727.00	310,114,700
アサヒグループホールディングス	323,700	5,520.00	1,786,824,000
キリンホールディングス	583,500	2,125.00	1,239,937,500

宝ホールディングス	95,600	1,249.00	119,404,400
オエノンホールディングス	41,900	356.00	14,916,400
養命酒製造	4,700	1,883.00	8,850,100
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	109,700	2,062.00	226,201,400
ライフドリンク カンパニー	2,100	5,020.00	10,542,000
サントリー食品インターナショナル	98,600	4,833.00	476,533,800
ダイドーグループホールディングス	7,900	6,050.00	47,795,000
伊藤園	47,400	4,407.00	208,891,800
キーコーヒー	15,800	2,088.00	32,990,400
ユニカフェ	2,600	927.00	2,410,200
ジャパンフーズ	1,200	1,365.00	1,638,000
日清オイリオグループ	19,700	4,470.00	88,059,000
不二製油グループ本社	32,600	2,496.50	81,385,900
かどや製油	900	3,765.00	3,388,500
J-オイルミルズ	16,100	2,023.00	32,570,300
ローソン	32,000	7,458.00	238,656,000
サンエー	11,500	4,625.00	53,187,500
カワチ薬品	11,700	2,736.00	32,011,200
エービーシー・マート	65,900	2,592.00	170,812,800
ハードオフコーポレーション	4,700	1,740.00	8,178,000
高千穂交易	4,300	3,880.00	16,684,000
アスクル	31,100	2,101.00	65,341,100
ゲオホールディングス	16,900	2,269.00	38,346,100
アダストリア	18,200	3,300.00	60,060,000
ジーフット	6,900	294.00	2,028,600
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	715.00	715,000
オルバヘルスケアホールディングス	1,200	1,839.00	2,206,800
伊藤忠食品	3,400	7,810.00	26,554,000
くら寿司	17,600	3,670.00	64,592,000
キャンドゥ	5,400	2,732.00	14,752,800
エレマテック	13,500	1,817.00	24,529,500
I Kホールディングス	2,700	330.00	891,000
パルグループホールディングス	29,600	2,204.00	65,238,400
エディオン	59,600	1,597.00	95,181,200
あらた	23,000	3,320.00	76,360,000
サーラコーポレーション	31,700	739.00	23,426,300
ワッツ	4,200	597.00	2,507,400
トーマンデバイス	2,200	5,330.00	11,726,000
ハローズ	6,900	4,280.00	29,532,000
J Pホールディングス	37,400	460.00	17,204,000
フジオフードグループ本社	16,900	1,428.00	24,133,200
あみやき亭	3,700	4,200.00	15,540,000
東京エレクトロン デバイス	14,900	6,250.00	93,125,000
ひらまつ	19,900	270.00	5,373,000
円谷フィールドホールディングス	25,800	1,457.00	37,590,600
双日	167,500	3,348.00	560,790,000
アルフレッサ ホールディングス	151,000	2,536.00	382,936,000
大黒天物産	4,700	7,160.00	33,652,000
ハニーズホールディングス	11,800	1,645.00	19,411,000

ファーマライズホールディングス	1,800	660.00	1,188,000
キッコーマン	92,800	9,269.00	860,163,200
味の素	332,800	5,824.00	1,938,227,200
ブルドックソース	7,400	2,250.00	16,650,000
キューピー	75,400	2,562.00	193,174,800
ハウス食品グループ本社	48,300	3,270.00	157,941,000
カゴメ	60,200	3,228.00	194,325,600
焼津水産化学工業	3,400	1,204.00	4,093,600
アリアケジャパン	13,900	4,575.00	63,592,500
ピエトロ	1,000	1,810.00	1,810,000
エバラ食品工業	3,400	2,917.00	9,917,800
やまみ	700	3,530.00	2,471,000
ニチレイ	64,300	3,577.00	230,001,100
横浜冷凍	41,000	1,058.00	43,378,000
東洋水産	70,800	8,000.00	566,400,000
イトアンドホールディングス	6,300	2,130.00	13,419,000
大冷	1,100	1,944.00	2,138,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,300	1,046.00	6,589,800
日清食品ホールディングス	147,600	5,089.00	751,136,400
永谷園ホールディングス	6,900	2,173.00	14,993,700
一正蒲鉾	3,400	751.00	2,553,400
フジッコ	14,300	1,969.00	28,156,700
ロック・フィールド	15,700	1,621.00	25,449,700
日本たばこ産業	851,100	3,795.00	3,229,924,500
ケンコーマヨネーズ	9,700	1,707.00	16,557,900
わらべや日洋ホールディングス	9,400	3,650.00	34,310,000
なとり	8,800	2,118.00	18,638,400
イフジ産業	1,500	1,356.00	2,034,000
ファーマフーズ	20,000	1,162.00	23,240,000
北の達人コーポレーション	60,100	217.00	13,041,700
ユーグレナ	87,200	710.00	61,912,000
紀文食品	12,100	1,188.00	14,374,800
ピクルスホールディングス	8,200	1,228.00	10,069,600
スター・マイカ・ホールディングス	16,300	650.00	10,595,000
SREホールディングス	6,000	2,826.00	16,956,000
ADワークスグループ	19,500	242.00	4,719,000
片倉工業	13,100	1,699.00	22,256,900
グンゼ	10,200	5,150.00	52,530,000
ヒューリック	326,700	1,569.50	512,755,650
神栄	1,200	1,876.00	2,251,200
ラサ商事	5,400	1,607.00	8,677,800
アルペン	12,400	1,962.00	24,328,800
ハブ	2,700	755.00	2,038,500
ラクーンホールディングス	11,800	643.00	7,587,400
クオールホールディングス	20,700	1,761.00	36,452,700
アルコニックス	19,700	1,376.00	27,107,200
神戸物産	116,400	4,004.00	466,065,600
ソリトンシステムズ	7,400	1,466.00	10,848,400
ジンズホールディングス	8,900	4,610.00	41,029,000
ビックカメラ	80,000	1,375.00	110,000,000

DCMホールディングス	79,500	1,342.00	106,689,000
ペッパーフードサービス	34,400	97.00	3,336,800
ハイパー	1,900	312.00	592,800
MonotaRO	213,400	1,513.50	322,980,900
東京一番フーズ	1,900	524.00	995,600
DDグループ	5,400	1,290.00	6,966,000
あいホールディングス	24,100	2,405.00	57,960,500
ディービーエックス	2,300	1,071.00	2,463,300
きちりホールディングス	2,000	1,030.00	2,060,000
J. フロント リテイリング	172,700	1,348.50	232,885,950
ドトール・日レスホールディングス	26,700	2,257.00	60,261,900
マツキヨココカラ&カンパニー	273,800	2,674.00	732,141,200
ブロンコビリー	8,800	3,240.00	28,512,000
ZOZO	95,900	3,310.00	317,429,000
トレジャー・ファクトリー	7,300	1,320.00	9,636,000
物語コーポレーション	25,100	4,840.00	121,484,000
三越伊勢丹ホールディングス	253,400	1,655.00	419,377,000
東洋紡	61,500	1,077.00	66,235,500
ユニチカ	46,200	172.00	7,946,400
富士紡ホールディングス	6,200	3,860.00	23,932,000
日清紡ホールディングス	108,000	1,180.00	127,440,000
倉敷紡績	10,700	2,904.00	31,072,800
ダイワボウホールディングス	66,600	3,167.00	210,922,200
シキボウ	6,500	1,175.00	7,637,500
日東紡績	18,100	5,140.00	93,034,000
トヨタ紡織	59,900	2,439.00	146,096,100
マクニカホールディングス	35,600	8,135.00	289,606,000
Hamee	5,200	1,000.00	5,200,000
マーケットエンタープライズ	800	1,047.00	837,600
ラクト・ジャパン	5,800	1,960.00	11,368,000
ウエルシアホールディングス	78,100	2,387.00	186,424,700
クリエイトSDホールディングス	24,900	3,120.00	77,688,000
グリムス	6,300	2,166.00	13,645,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,800	1,069.00	24,373,200
八洲電機	12,100	1,369.00	16,564,900
メディアスホールディングス	9,700	799.00	7,750,300
レスターホールディングス	12,800	2,877.00	36,825,600
ジオリーヴグループ	1,900	1,356.00	2,576,400
丸善CHIホールディングス	10,000	332.00	3,320,000
大光	3,600	629.00	2,264,400
OCHIホールディングス	1,900	1,544.00	2,933,600
TOKAIホールディングス	81,700	998.00	81,536,600
黒谷	2,400	600.00	1,440,000
ミサワ	1,800	685.00	1,233,000
ティーライフ	1,100	1,437.00	1,580,700
Cominix	1,700	821.00	1,395,700
エー・ピーホールディングス	2,000	930.00	1,860,000
三洋貿易	17,000	1,236.00	21,012,000
チムニー	2,600	1,455.00	3,783,000

シュッピン	13,600	1,138.00	15,476,800
ビューティガレージ	4,700	2,288.00	10,753,600
オイシックス・ラ・大地	20,200	1,428.00	28,845,600
ウイン・パートナーズ	9,900	1,226.00	12,137,400
ネクステージ	34,400	2,303.00	79,223,200
ジョイフル本田	43,800	1,921.00	84,139,800
鳥貴族ホールディングス	5,600	3,435.00	19,236,000
ホットランド	11,500	1,923.00	22,114,500
すかいらーくホールディングス	205,700	2,223.00	457,271,100
SFPホールディングス	8,200	2,147.00	17,605,400
綿半ホールディングス	11,700	1,437.00	16,812,900
日本毛織	37,600	1,351.00	50,797,600
ダイトウボウ	12,900	93.00	1,199,700
トーア紡コーポレーション	3,100	435.00	1,348,500
ダイドーリミテッド	11,400	439.00	5,004,600
ヨシックスホールディングス	2,700	2,812.00	7,592,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	42,000	1,023.00	42,966,000
野村不動産ホールディングス	78,000	4,086.00	318,708,000
三重交通グループホールディングス	30,000	615.00	18,450,000
サムティ	22,300	2,548.00	56,820,400
ディア・ライフ	23,900	969.00	23,159,100
コーセーアールイー	2,400	1,101.00	2,642,400
地主	10,700	2,351.00	25,155,700
プレサンスコーポレーション	22,200	1,651.00	36,652,200
フィル・カンパニー	2,200	629.00	1,383,800
THEグローバル社	4,600	402.00	1,849,200
ハウスコム	1,200	926.00	1,111,200
JPMC	8,100	1,121.00	9,080,100
サンセイラディック	2,300	1,031.00	2,371,300
エストラスト	800	648.00	518,400
フージャースホールディングス	21,600	1,121.00	24,213,600
オープンハウスグループ	51,400	4,538.00	233,253,200
東急不動産ホールディングス	421,100	989.00	416,467,900
飯田グループホールディングス	134,200	2,341.00	314,162,200
イーグランド	1,100	1,557.00	1,712,700
ムゲンエステート	5,200	1,107.00	5,756,400
帝国繊維	16,100	2,160.00	34,776,000
日本コークス工業	144,700	125.00	18,087,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	676.00	4,529,200
ミタチ産業	2,100	1,118.00	2,347,800
BENOS	6,100	1,397.00	8,521,700
あさひ	13,900	1,300.00	18,070,000
日本調剤	10,300	1,403.00	14,450,900
コスモス薬品	14,800	16,040.00	237,392,000
シップヘルスケアホールディングス	54,100	2,307.00	124,808,700
トーエル	3,800	774.00	2,941,200
ソフトクリエイトホールディングス	11,700	1,752.00	20,498,400
セブン&アイ・ホールディングス	518,600	5,857.00	3,037,440,200
クリエイト・レストランツ・ホール	101,800	1,150.00	117,070,000

ディングス				
明治電機工業	5,600	1,429.00	8,002,400	
ツルハホールディングス	31,600	12,935.00	408,746,000	
デリカフーズホールディングス	3,600	595.00	2,142,000	
スターティアホールディングス	2,200	1,365.00	3,003,000	
サンマルクホールディングス	12,100	2,169.00	26,244,900	
フェリシモ	1,900	962.00	1,827,800	
トリドールホールディングス	42,100	4,390.00	184,819,000	
帝人	136,900	1,374.00	188,100,600	
東レ	954,700	747.80	713,924,660	
クラレ	207,600	1,481.50	307,559,400	
旭化成	963,900	1,097.00	1,057,398,300	
TOKYO BASE	18,100	336.00	6,081,600	
稲葉製作所	7,700	1,548.00	11,919,600	
宮地エンジニアリンググループ	7,400	3,425.00	25,345,000	
トーカロ	42,400	1,530.00	64,872,000	
アルファ	2,900	1,437.00	4,167,300	
SUMCO	260,800	2,171.50	566,327,200	
川田テクノロジーズ	3,500	7,100.00	24,850,000	
RS Technologies	9,900	2,996.00	29,660,400	
ジェイテックコーポレーション	1,000	2,290.00	2,290,000	
信和	5,300	778.00	4,123,400	
ビーロット	5,300	1,003.00	5,315,900	
ファーストブラザーズ	1,500	1,035.00	1,552,500	
And Doホールディングス	8,400	1,070.00	8,988,000	
シーアールイー	7,800	1,458.00	11,372,400	
ケイアイスター不動産	6,700	3,375.00	22,612,500	
アグレ都市デザイン	1,400	1,589.00	2,224,600	
グッドコムアセット	13,000	722.00	9,386,000	
ジェイ・エス・ビー	7,000	2,530.00	17,710,000	
ロードスターキャピタル	9,100	1,952.00	17,763,200	
テンポイノベーション	2,300	1,018.00	2,341,400	
グローバル・リンク・マネジメント	1,500	2,337.00	3,505,500	
フェイスネットワーク	2,100	1,523.00	3,198,300	
霞ヶ関キャピタル	3,300	9,000.00	29,700,000	
住江織物	1,600	2,415.00	3,864,000	
日本フェルト	4,900	429.00	2,102,100	
イチカラ	900	1,673.00	1,505,700	
エコナックホールディングス	7,200	131.00	943,200	
日東製網	800	1,550.00	1,240,000	
芦森工業	1,600	2,129.00	3,406,400	
アツギ	5,600	504.00	2,822,400	
ウイルプラスホールディングス	1,400	1,005.00	1,407,000	
JMホールディングス	11,400	2,167.00	24,703,800	
コマダホールディングス	36,900	2,803.00	103,430,700	
サツドラホールディングス	3,800	800.00	3,040,000	
アレンザホールディングス	11,300	1,069.00	12,079,700	
串カツ田中ホールディングス	4,000	1,619.00	6,476,000	
パロックジャパンリミテッド	11,700	826.00	9,664,200	
クスリのアオキホールディングス	40,300	3,246.00	130,813,800	

ダイニック	2,500	734.00	1,835,000
共和レザー	4,700	809.00	3,802,300
ピーバンドットコム	1,000	409.00	409,000
力の源ホールディングス	6,700	1,503.00	10,070,100
FOOD & LIFE COMPANIES	80,200	2,943.00	236,028,600
アセンテック	5,800	504.00	2,923,200
セーレン	27,500	2,490.00	68,475,000
ソトー	2,500	701.00	1,752,500
東海染工	800	873.00	698,400
小松マテーレ	20,700	869.00	17,988,300
ワコールホールディングス	29,200	3,544.00	103,484,800
ホギメディカル	18,800	3,585.00	67,398,000
クラウディアホールディングス	1,800	463.00	833,400
T S I ホールディングス	46,300	760.00	35,188,000
マツオカコーポレーション	2,400	1,485.00	3,564,000
ワールド	20,000	1,703.00	34,060,000
T I S	156,000	3,337.00	520,572,000
テクミラホールディングス	3,700	474.00	1,753,800
グリー	38,200	602.00	22,996,400
GMOペパボ	1,700	1,225.00	2,082,500
コーエーテクモホールディングス	89,400	1,767.00	157,969,800
三菱総合研究所	7,000	4,755.00	33,285,000
ボルテージ	2,300	266.00	611,800
電算	800	1,512.00	1,209,600
A G S	3,300	850.00	2,805,000
ファインデックス	11,300	942.00	10,644,600
ブレインパッド	10,700	1,142.00	12,219,400
K L a b	26,200	290.00	7,598,000
ポルトウウィンホールディングス	24,400	475.00	11,590,000
ネクソン	318,700	2,816.00	897,459,200
アイスタイル	42,400	419.00	17,765,600
エムアップホールディングス	17,400	1,044.00	18,165,600
エイチーム	8,400	588.00	4,939,200
エニグモ	18,200	364.00	6,624,800
テクノスジャパン	7,100	647.00	4,593,700
e n i s h	7,100	161.00	1,143,100
コロプラ	55,300	603.00	33,345,900
オルトプラス	6,900	148.00	1,021,200
ブロードリーフ	67,700	580.00	39,266,000
クロス・マーケティンググループ	4,800	566.00	2,716,800
デジタルハーツホールディングス	8,800	1,003.00	8,826,400
メディアドゥ	6,400	1,433.00	9,171,200
じげん	41,600	535.00	22,256,000
ブイキューブ	17,100	307.00	5,249,700
エンカレッジ・テクノロジー	1,900	575.00	1,092,500
サイバーリンクス	3,100	804.00	2,492,400
ディー・エル・イー	5,700	200.00	1,140,000
フィックスターズ	16,100	1,304.00	20,994,400
CARTA HOLDINGS	6,600	1,429.00	9,431,400

オブティム	14,600	941.00	13,738,600
セレス	5,700	1,310.00	7,467,000
SHIFT	9,500	35,210.00	334,495,000
特種東海製紙	7,800	4,085.00	31,863,000
ティーガイア	14,800	1,977.00	29,259,600
セック	1,500	5,020.00	7,530,000
テクマトリックス	26,100	1,727.00	45,074,700
プロシップ	6,900	1,407.00	9,708,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	37,200	2,482.00	92,330,400
GMOペイメントゲートウェイ	28,500	9,737.00	277,504,500
ザッパラス	2,200	473.00	1,040,600
システムリサーチ	4,900	3,040.00	14,896,000
インターネットイニシアティブ	68,200	2,938.00	200,371,600
さくらインターネット	16,000	2,569.00	41,104,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,400	2,768.00	12,179,200
SRAホールディングス	7,300	3,770.00	27,521,000
システムインテグレータ	2,300	426.00	979,800
朝日ネット	15,400	626.00	9,640,400
eBASE	20,000	771.00	15,420,000
アバントグループ	18,100	1,476.00	26,715,600
アドソル日進	6,000	1,593.00	9,558,000
ODKソリューションズ	1,600	611.00	977,600
フリービット	7,500	1,415.00	10,612,500
コムチュア	20,600	1,884.00	38,810,400
アステリア	11,200	651.00	7,291,200
アイル	6,600	3,320.00	21,912,000
王子ホールディングス	593,600	573.00	340,132,800
日本製紙	80,300	1,320.00	105,996,000
三菱製紙	10,700	572.00	6,120,400
北越コーポレーション	70,100	1,480.00	103,748,000
中越パルプ工業	3,200	1,915.00	6,128,000
巴川コーポレーション	2,200	1,043.00	2,294,600
大王製紙	62,900	1,152.00	72,460,800
阿波製紙	2,200	563.00	1,238,600
マークライNZ	7,700	3,000.00	23,100,000
メディカル・データ・ビジョン	17,000	669.00	11,373,000
gumi	21,100	423.00	8,925,300
ショーケース	1,800	305.00	549,000
モバイルファクトリー	1,700	653.00	1,110,100
テラスカイ	6,100	1,740.00	10,614,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,200	1,694.00	13,890,800
PCIホールディングス	3,100	1,013.00	3,140,300
アイビーシー	1,200	470.00	564,000
ネオジャパン	4,800	1,052.00	5,049,600
PR TIMES	2,800	1,863.00	5,216,400
ラクス	67,500	2,431.00	164,092,500
ランドコンピュータ	4,700	918.00	4,314,600

ダブルスタンダード	4,400	1,606.00	7,066,400
オープンドア	8,300	818.00	6,789,400
マイネット	2,500	296.00	740,000
アカツキ	6,700	2,432.00	16,294,400
ベネフィットジャパン	500	1,246.00	623,000
Ubicomホールディングス	4,500	1,622.00	7,299,000
カナミックネットワーク	15,400	422.00	6,498,800
ノムラシステムコーポレーション	8,700	119.00	1,035,300
レンゴー	129,800	962.60	124,945,480
トーモク	8,200	2,294.00	18,810,800
ザ・パック	10,600	3,325.00	35,245,000
チェンジホールディングス	31,000	1,419.00	43,989,000
シンクロ・フード	5,000	637.00	3,185,000
オークネット	5,600	1,935.00	10,836,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,600	766.00	1,225,600
セグエグループ	2,500	915.00	2,287,500
エイトレッド	1,100	1,429.00	1,571,900
マクロミル	28,000	810.00	22,680,000
ビーグリー	1,700	1,203.00	2,045,100
オロ	5,200	2,969.00	15,438,800
ユーザーローカル	5,200	1,846.00	9,599,200
テモナ	1,800	298.00	536,400
ニーズウェル	4,400	759.00	3,339,600
マネーフォワード	31,700	4,447.00	140,969,900
サインポスト	3,100	380.00	1,178,000
レゾナック・ホールディングス	137,700	2,945.50	405,595,350
住友化学	1,057,200	360.10	380,697,720
住友精化	6,600	5,210.00	34,386,000
日産化学	67,000	5,897.00	395,099,000
ラサ工業	5,500	2,126.00	11,693,000
クレハ	31,200	2,916.00	90,979,200
多木化学	5,600	3,215.00	18,004,000
テイカ	12,400	1,427.00	17,694,800
石原産業	23,700	1,476.00	34,981,200
片倉コープアグリ	1,900	1,132.00	2,150,800
日本曹達	16,800	5,730.00	96,264,000
東ソー	190,300	1,919.00	365,185,700
トクヤマ	46,100	2,504.00	115,434,400
セントラル硝子	15,300	2,776.00	42,472,800
東亜合成	71,400	1,357.00	96,889,800
大阪ソーダ	10,000	9,280.00	92,800,000
関東電化工業	27,600	866.00	23,901,600
SUN ASTERISK	10,200	963.00	9,822,600
デンカ	51,800	2,596.00	134,472,800
イビデン	74,800	8,074.00	603,935,200
信越化学工業	1,292,100	5,606.00	7,243,512,600
日本カーバイド工業	5,300	1,495.00	7,923,500
プラスアルファ・コンサルティング	8,400	2,753.00	23,125,200
電算システムホールディングス	6,300	2,883.00	18,162,900
堺化学工業	10,900	1,936.00	21,102,400

第一稀元素化学工業	15,600	1,013.00	15,802,800
エア・ウォーター	134,400	1,972.00	265,036,800
日本酸素ホールディングス	138,300	3,894.00	538,540,200
日本化学工業	5,200	1,907.00	9,916,400
東邦アセチレン	8,500	376.00	3,196,000
日本パーカライジング	63,500	1,158.00	73,533,000
高压ガス工業	20,800	891.00	18,532,800
チタン工業	1,000	1,151.00	1,151,000
四国化成ホールディングス	18,300	1,896.00	34,696,800
戸田工業	3,300	1,575.00	5,197,500
ステラ ケミファ	7,700	3,290.00	25,333,000
保土谷化学工業	4,500	3,795.00	17,077,500
日本触媒	20,700	5,585.00	115,609,500
大日精化工業	10,000	2,675.00	26,750,000
カネカ	36,100	3,700.00	133,570,000
協和キリン	172,400	2,528.50	435,913,400
APPIER GROUP	48,700	1,848.00	89,997,600
三菱瓦斯化学	106,400	2,418.00	257,275,200
三井化学	117,500	4,407.00	517,822,500
J S R	155,200	4,058.00	629,801,600
東京応化工業	68,100	3,207.00	218,396,700
大阪有機化学工業	11,900	2,630.00	31,297,000
三菱ケミカルグループ	1,041,600	903.30	940,877,280
KHネオケム	21,800	2,296.00	50,052,800
ダイセル	183,200	1,463.00	268,021,600
住友ベークライト	19,900	7,459.00	148,434,100
積水化学工業	286,300	2,138.00	612,109,400
日本ゼオン	97,700	1,316.00	128,573,200
アイカ工業	35,900	3,550.00	127,445,000
UBE	67,800	2,418.00	163,940,400
積水樹脂	21,300	2,495.00	53,143,500
タキロンシーアイ	36,300	661.00	23,994,300
旭有機材	9,500	3,970.00	37,715,000
ニチバン	7,700	1,778.00	13,690,600
リケンテクノス	30,600	859.00	26,285,400
大倉工業	6,500	2,572.00	16,718,000
積水化成成品工業	20,000	500.00	10,000,000
群栄化学工業	3,400	3,225.00	10,965,000
タイガースポリマー	3,600	874.00	3,146,400
ミライアル	2,600	1,489.00	3,871,400
ダイキアクシス	3,300	732.00	2,415,600
ダイキョーニシカワ	31,500	728.00	22,932,000
竹本容器	3,100	782.00	2,424,200
森六ホールディングス	7,400	2,847.00	21,067,800
恵和	10,300	1,286.00	13,245,800
日本化薬	108,800	1,379.00	150,035,200
カーリットホールディングス	15,400	923.00	14,214,200
ソルクシーズ	6,400	402.00	2,572,800
CLホールディングス	3,500	886.00	3,101,000
プレステージ・インターナショナル	68,400	600.00	41,040,000

フェイス	2,200	483.00	1,062,600
プロトコーポレーション	15,700	1,310.00	20,567,000
ハイマックス	4,500	1,451.00	6,529,500
アミューズ	8,900	1,536.00	13,670,400
野村総合研究所	316,100	4,408.00	1,393,368,800
ドリームインキュベータ	5,000	3,170.00	15,850,000
クイック	10,200	2,589.00	26,407,800
T A C	3,900	199.00	776,100
C Eホールディングス	4,000	640.00	2,560,000
日本システム技術	4,700	3,075.00	14,452,500
電通グループ	143,700	3,914.00	562,441,800
インテージホールディングス	16,200	1,753.00	28,398,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,900	1,176.00	5,762,400
東邦システムサイエンス	4,700	1,274.00	5,987,800
ぴあ	5,000	3,435.00	17,175,000
イオンファンタジー	5,300	2,629.00	13,933,700
ソースネクスト	65,300	165.00	10,774,500
シーティーエス	18,500	687.00	12,709,500
N E X Y Z . G r o u p	2,500	706.00	1,765,000
インフォコム	18,400	2,435.00	44,804,000
メディカルシステムネットワーク	16,300	671.00	10,937,300
日本精化	9,500	3,100.00	29,450,000
扶桑化学工業	15,200	4,440.00	67,488,000
トリケミカル研究所	17,300	3,820.00	66,086,000
シンプレクス・ホールディングス	21,500	2,784.00	59,856,000
HEROZ	4,800	1,752.00	8,409,600
ラクスル	34,400	1,131.00	38,906,400
メルカリ	86,500	2,528.50	218,715,250
I P S	4,000	2,025.00	8,100,000
F I G	9,300	322.00	2,994,600
システムサポート	5,500	1,865.00	10,257,500
A D E K A	49,600	2,912.00	144,435,200
日油	43,000	7,019.00	301,817,000
ミヨシ油脂	2,900	1,312.00	3,804,800
新日本理化	10,900	197.00	2,147,300
ハリマ化成グループ	7,700	855.00	6,583,500
イーソル	10,400	605.00	6,292,000
東海ソフト	1,100	1,177.00	1,294,700
ウイングアーク1st	14,700	2,884.00	42,394,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,800	1,296.00	4,924,800
サーバーワークス	2,900	3,200.00	9,280,000
東名	600	1,800.00	1,080,000
ヴィッツ	700	887.00	620,900
トピラスシステムズ	2,200	908.00	1,997,600
S a n s a n	46,700	1,485.00	69,349,500
L i n k - U	1,900	735.00	1,396,500
ギフトィ	12,500	1,695.00	21,187,500
花王	322,200	5,950.00	1,917,090,000
第一工業製薬	5,700	1,931.00	11,006,700

石原ケミカル	6,500	1,965.00	12,772,500
日華化学	3,200	939.00	3,004,800
ニイタカ	1,400	1,894.00	2,651,600
三洋化成工業	8,700	4,450.00	38,715,000
メドレー	19,100	4,400.00	84,040,000
ベース	4,900	3,450.00	16,905,000
JMDC	24,300	4,210.00	102,303,000
武田薬品工業	1,262,600	4,341.00	5,480,946,600
アステラス製薬	1,251,500	1,764.00	2,207,646,000
住友ファーマ	105,900	489.00	51,785,100
塩野義製薬	179,900	7,256.00	1,305,354,400
わかもと製薬	8,400	220.00	1,848,000
日本新薬	37,400	5,189.00	194,068,600
中外製薬	446,600	5,835.00	2,605,911,000
科研製薬	24,400	3,495.00	85,278,000
エーザイ	173,600	7,671.00	1,331,685,600
理研ビタミン	12,100	2,300.00	27,830,000
ロート製薬	138,200	3,106.00	429,249,200
小野薬品工業	302,700	2,663.00	806,090,100
久光製薬	31,700	4,562.00	144,615,400
有機合成薬品工業	6,400	287.00	1,836,800
持田製薬	16,400	3,400.00	55,760,000
参天製薬	259,900	1,457.50	378,804,250
扶桑薬品工業	5,100	1,996.00	10,179,600
日本ケミファ	800	1,615.00	1,292,000
ツムラ	44,800	2,751.50	123,267,200
テルモ	397,700	4,980.00	1,980,546,000
H. U. グループホールディングス	42,800	2,793.50	119,561,800
キッセイ薬品工業	23,700	3,245.00	76,906,500
生化学工業	24,200	787.00	19,045,400
栄研化学	26,200	1,729.00	45,299,800
鳥居薬品	7,700	3,660.00	28,182,000
JCRファーマ	48,300	1,214.00	58,636,200
東和薬品	21,900	2,530.00	55,407,000
富士製薬工業	10,600	1,903.00	20,171,800
ゼリア新薬工業	19,700	2,054.00	40,463,800
そーせいグループ	46,000	1,590.00	73,140,000
第一三共	1,242,900	4,499.00	5,591,807,100
杏林製薬	30,900	1,827.00	56,454,300
大幸薬品	29,300	298.00	8,731,400
ダイト	11,000	1,944.00	21,384,000
大塚ホールディングス	296,700	5,868.00	1,741,035,600
大正製薬ホールディングス	31,700	8,620.00	273,254,000
ペプチドリーム	69,200	1,455.50	100,720,600
大日本塗料	15,900	1,066.00	16,949,400
日本ペイントホールディングス	756,600	1,156.00	874,629,600
関西ペイント	139,600	2,603.50	363,448,600
神東塗料	6,900	130.00	897,000
中国塗料	29,300	1,752.00	51,333,600
日本特殊塗料	5,700	1,252.00	7,136,400

藤倉化成	17,500	440.00	7,700,000
太陽ホールディングス	24,800	3,165.00	78,492,000
D I C	55,600	2,720.50	151,259,800
サカタインクス	31,700	1,374.00	43,555,800
a r t i e n c e	30,900	2,700.00	83,430,000
T&K TOKA	12,300	1,481.00	18,216,300
アルプス技研	13,800	2,751.00	37,963,800
サニックス	23,500	317.00	7,449,500
日本空調サービス	15,900	833.00	13,244,700
オリエンタルランド	773,900	5,462.00	4,227,041,800
フォーカスシステムズ	9,500	1,014.00	9,633,000
ダスキン	32,500	3,416.00	111,020,000
パーク24	90,900	1,857.50	168,846,750
明光ネットワークジャパン	17,800	742.00	13,207,600
ファルコホールディングス	6,600	2,149.00	14,183,400
クレスコ	11,700	1,984.00	23,212,800
フジ・メディア・ホールディングス	137,000	1,705.00	233,585,000
秀英予備校	1,900	311.00	590,900
田谷	1,400	415.00	581,000
ラウンドワン	137,500	606.00	83,325,000
リゾートトラスト	63,500	2,522.00	160,147,000
オービック	47,600	24,945.00	1,187,382,000
ジャストシステム	20,500	3,250.00	66,625,000
TDCソフト	13,400	2,166.00	29,024,400
L I N Eヤフー	2,030,700	485.90	986,717,130
ビー・エム・エル	18,000	2,976.00	53,568,000
トレンドマイクロ	67,400	8,179.00	551,264,600
IDホールディングス	9,700	1,707.00	16,557,900
リソー教育	74,800	237.00	17,727,600
日本オラクル	27,300	11,425.00	311,902,500
早稲田アカデミー	8,100	1,793.00	14,523,300
アルファシステムズ	3,700	3,095.00	11,451,500
フューチャー	30,400	1,830.00	55,632,000
C A C H o l d i n g s	7,700	1,762.00	13,567,400
S Bテクノロジー	6,000	2,420.00	14,520,000
トーセ	2,200	720.00	1,584,000
ユー・エス・エス	164,000	2,927.50	480,110,000
オービックビジネスコンサルタント	20,000	6,880.00	137,600,000
アイティフォー	18,300	1,218.00	22,289,400
東京個別指導学院	17,400	451.00	7,847,400
東計電算	4,000	3,570.00	14,280,000
サイバーエージェント	323,100	924.90	298,835,190
楽天グループ	1,252,400	643.70	806,169,880
エックスネット	1,000	1,159.00	1,159,000
クリーク・アンド・リバー社	7,400	2,211.00	16,361,400
S B Iグローバルアセットマネジメント	28,800	649.00	18,691,200
テー・オー・ダブリュー	28,800	330.00	9,504,000
大塚商会	70,800	6,148.00	435,278,400
サイボウズ	19,600	2,152.00	42,179,200

山田コンサルティンググループ	6,300	1,776.00	11,188,800
セントラルスポーツ	5,500	2,494.00	13,717,000
パラカ	5,000	1,953.00	9,765,000
電通総研	17,300	5,930.00	102,589,000
ACCESS	14,700	793.00	11,657,100
デジタルガレージ	22,800	3,695.00	84,246,000
イーエムシステムズ	23,800	726.00	17,278,800
ウェザーニューズ	4,500	5,380.00	24,210,000
C I J	23,700	686.00	16,258,200
ビジネスエンジニアリング	2,300	4,210.00	9,683,000
日本エンタープライズ	8,200	128.00	1,049,600
WOWOW	10,800	1,132.00	12,225,600
スカラ	13,200	751.00	9,913,200
インテリジェント ウェイブ	4,300	1,025.00	4,407,500
フルキャストホールディングス	13,900	1,889.00	26,257,100
エン・ジャパン	23,800	2,751.00	65,473,800
あすか製薬ホールディングス	14,500	1,824.00	26,448,000
サワイグループホールディングス	32,600	5,514.00	179,756,400
富士フイルムホールディングス	264,700	8,926.00	2,362,712,200
コニカミノルタ	320,800	428.20	137,366,560
資生堂	297,900	4,199.00	1,250,882,100
ライオン	186,700	1,339.00	249,991,300
高砂香料工業	10,700	3,580.00	38,306,000
マンダム	30,800	1,303.00	40,132,400
ミルボン	19,300	3,709.00	71,583,700
ファンケル	62,400	2,370.50	147,919,200
コーセー	29,100	10,335.00	300,748,500
コタ	13,100	1,598.00	20,933,800
シーボン	1,100	1,503.00	1,653,300
ポーラ・オルビスホールディングス	73,100	1,564.00	114,328,400
ノエビアホールディングス	12,700	5,290.00	67,183,000
アジュバンホールディングス	2,000	937.00	1,874,000
新日本製薬	8,100	1,763.00	14,280,300
I - n e	2,800	2,475.00	6,930,000
アクシージア	7,300	907.00	6,621,100
エステー	11,000	1,552.00	17,072,000
アグロ カネショウ	5,700	1,495.00	8,521,500
コニシ	41,200	1,433.00	59,039,600
長谷川香料	27,300	3,225.00	88,042,500
小林製薬	41,500	6,799.00	282,158,500
荒川化学工業	12,000	1,062.00	12,744,000
メック	11,700	4,395.00	51,421,500
日本高純度化学	3,300	2,511.00	8,286,300
タカラバイオ	38,400	1,253.00	48,115,200
J C U	16,000	3,755.00	60,080,000
新田ゼラチン	5,400	779.00	4,206,600
O A Tアグリオ	4,200	1,765.00	7,413,000
デクセリアルズ	35,800	4,335.00	155,193,000
アース製薬	13,000	4,625.00	60,125,000
北興化学工業	14,300	1,088.00	15,558,400

大成ラミック	4,200	2,967.00	12,461,400
クミアイ化学工業	56,600	865.00	48,959,000
日本農薬	26,200	665.00	17,423,000
富士興産	2,300	1,940.00	4,462,000
ニチレキ	18,600	2,442.00	45,421,200
ユシロ化学工業	7,400	1,775.00	13,135,000
ビービー・カストロール	3,100	883.00	2,737,300
富士石油	41,600	371.00	15,433,600
MORESCO	2,800	1,358.00	3,802,400
出光興産	792,000	805.30	637,797,600
ENEOSホールディングス	2,258,700	595.70	1,345,507,590
コスモエネルギーホールディングス	42,200	6,148.00	259,445,600
ANYCOLOR	5,000	3,400.00	17,000,000
テスホールディングス	30,100	444.00	13,364,400
インフロニア・ホールディングス	160,800	1,498.50	240,958,800
横浜ゴム	72,100	3,402.00	245,284,200
TOYO TIRE	82,000	2,472.00	202,704,000
ブリヂストン	417,700	6,100.00	2,547,970,000
住友ゴム工業	139,800	1,650.00	230,670,000
藤倉コンポジット	9,700	1,446.00	14,026,200
オカモト	6,700	5,040.00	33,768,000
アキレス	8,900	1,623.00	14,444,700
フコク	7,500	1,396.00	10,470,000
ニッタ	14,400	3,830.00	55,152,000
クリエートメディック	2,500	897.00	2,242,500
住友理工	22,200	1,121.00	24,886,200
三ツ星ベルト	17,300	4,710.00	81,483,000
バンドー化学	21,200	1,729.00	36,654,800
AGC	127,200	5,422.00	689,678,400
日本板硝子	68,000	601.00	40,868,000
石塚硝子	1,400	3,500.00	4,900,000
有沢製作所	24,900	1,085.00	27,016,500
日本山村硝子	2,900	1,408.00	4,083,200
日本電気硝子	58,200	3,174.00	184,726,800
オハラ	6,700	1,186.00	7,946,200
住友大阪セメント	23,800	3,768.00	89,678,400
太平洋セメント	84,400	2,986.00	252,018,400
リソルホールディングス	700	6,050.00	4,235,000
日本ヒューム	12,500	909.00	11,362,500
日本コンクリート工業	27,800	360.00	10,008,000
三谷セキサン	5,900	5,380.00	31,742,000
アジアパイルホールディングス	20,200	727.00	14,685,400
東海カーボン	131,600	1,055.50	138,903,800
日本カーボン	7,600	4,420.00	33,592,000
東洋炭素	10,100	4,895.00	49,439,500
ノリタケカンパニーリミテド	7,900	7,170.00	56,643,000
TOTO	94,100	3,916.00	368,495,600
日本碍子	166,000	1,778.50	295,231,000
日本特殊陶業	119,500	3,664.00	437,848,000
ダントーホールディングス	5,300	1,082.00	5,734,600

MARUWA	5,300	28,780.00	152,534,000
品川リフラクトリーズ	17,500	1,876.00	32,830,000
黒崎播磨	2,900	11,780.00	34,162,000
ヨータイ	8,800	1,495.00	13,156,000
東京窯業	8,600	450.00	3,870,000
ニッカトー	3,600	582.00	2,095,200
フジインコーポレーテッド	38,300	2,988.00	114,440,400
クニミネ工業	2,300	1,042.00	2,396,600
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,311.00	2,228,700
ニチアス	36,000	3,410.00	122,760,000
日本製鉄	657,300	3,349.00	2,201,297,700
神戸製鋼所	295,100	1,930.00	569,543,000
中山製鋼所	33,600	852.00	28,627,200
合同製鉄	8,200	4,845.00	39,729,000
JFEホールディングス	408,200	2,304.00	940,492,800
東京製鉄	41,300	1,807.00	74,629,100
共英製鋼	16,800	2,093.00	35,162,400
大和工業	27,700	7,779.00	215,478,300
東京鐵鋼	6,400	4,430.00	28,352,000
大阪製鐵	6,900	2,428.00	16,753,200
淀川製鋼所	16,700	3,960.00	66,132,000
中部鋼鈹	9,700	2,474.00	23,997,800
丸一鋼管	44,600	3,770.00	168,142,000
モリ工業	2,600	4,525.00	11,765,000
大同特殊鋼	92,500	1,501.50	138,888,750
日本高周波鋼業	3,200	586.00	1,875,200
日本冶金工業	10,800	4,360.00	47,088,000
山陽特殊製鋼	14,500	2,624.00	38,048,000
愛知製鋼	8,400	3,235.00	27,174,000
日本金属	2,200	886.00	1,949,200
ミガロホールディングス	1,100	1,401.00	1,541,100
大平洋金属	12,600	1,199.00	15,107,400
新日本電工	73,200	280.00	20,496,000
栗本鐵工所	6,900	3,325.00	22,942,500
虹 技	1,000	1,179.00	1,179,000
日本鑄鐵管	800	1,130.00	904,000
日本製鋼所	39,700	2,488.00	98,773,600
三菱製鋼	10,900	1,513.00	16,491,700
日亜鋼業	8,700	325.00	2,827,500
日本精線	2,100	5,000.00	10,500,000
エンビプロ・ホールディングス	7,800	605.00	4,719,000
大紀アルミニウム工業所	18,600	1,218.00	22,654,800
日本輕金属ホールディングス	42,900	1,764.00	75,675,600
三井金属鋁業	42,700	4,539.00	193,815,300
東邦亜鉛	9,400	1,166.00	10,960,400
三菱マテリアル	104,900	2,605.00	273,264,500
住友金属鋁山	170,100	4,244.00	721,904,400
DOWAホールディングス	36,200	5,213.00	188,710,600
古河機械金属	19,400	1,933.00	37,500,200
エス・サイエンス	50,300	23.00	1,156,900

大阪チタニウムテクノロジーズ	25,400	2,741.00	69,621,400
東邦チタニウム	30,300	1,864.00	56,479,200
UACJ	20,600	3,830.00	78,898,000
CKサンエツ	2,700	3,955.00	10,678,500
古河電気工業	48,800	2,386.50	116,461,200
住友電気工業	549,100	1,906.50	1,046,859,150
フジクラ	173,100	1,137.00	196,814,700
SWCC	16,400	2,890.00	47,396,000
タツタ電線	26,100	703.00	18,348,300
カナレ電気	1,400	1,618.00	2,265,200
平河ヒューテック	9,400	1,385.00	13,019,000
いよぎんホールディングス	166,700	985.40	164,266,180
しずおかフィナンシャルグループ	311,300	1,266.50	394,261,450
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	118,000	1,023.00	120,714,000
楽天銀行	48,700	2,242.00	109,185,400
京都フィナンシャルグループ	177,200	2,320.50	411,192,600
リョービ	15,700	2,851.00	44,760,700
アーレスティ	8,900	744.00	6,621,600
AREホールディングス	55,200	1,990.00	109,848,000
東洋製罐グループホールディングス	87,600	2,402.50	210,459,000
ホッカインホールディングス	7,200	1,712.00	12,326,400
コロナ	8,200	961.00	7,880,200
横河ブリッジホールディングス	22,900	2,740.00	62,746,000
駒井ハルテック	1,500	2,084.00	3,126,000
高田機工	600	3,500.00	2,100,000
三和ホールディングス	147,500	2,210.00	325,975,000
文化シャッター	38,300	1,455.00	55,726,500
三協立山	16,800	848.00	14,246,400
アルインコ	11,200	1,034.00	11,580,800
東洋シャッター	1,900	678.00	1,288,200
LIXIL	229,100	1,890.50	433,113,550
日本フィルコン	5,300	486.00	2,575,800
ノーリツ	24,300	1,530.00	37,179,000
長府製作所	14,500	2,094.00	30,363,000
リンナイ	71,800	3,345.00	240,171,000
ユニプレス	25,500	992.00	25,296,000
ダイニチ工業	4,300	721.00	3,100,300
日東精工	21,400	549.00	11,748,600
三洋工業	900	2,904.00	2,613,600
岡部	26,200	758.00	19,859,600
ジーテクト	18,700	1,798.00	33,622,600
東プレ	25,800	1,982.00	51,135,600
高周波熱錬	22,600	1,000.00	22,600,000
東京製綱	9,500	1,384.00	13,148,000
サンコール	11,400	463.00	5,278,200
モリテックスチール	7,300	294.00	2,146,200
パイオラックス	18,200	2,463.00	44,826,600
エイチワン	15,200	839.00	12,752,800
日本発条	129,900	1,228.50	159,582,150
中央発條	10,900	709.00	7,728,100

アドバネクス	900	984.00	885,600
三浦工業	60,000	2,844.50	170,670,000
タクマ	48,600	1,777.00	86,362,200
テクノプロ・ホールディングス	85,600	3,664.00	313,638,400
アトラグループ	2,400	190.00	456,000
アイ・アールジャパンホールディングス	7,600	1,611.00	12,243,600
Keepers 技研	8,900	6,660.00	59,274,000
ファーストロジック	1,900	540.00	1,026,000
三機サービス	1,200	1,377.00	1,652,400
Gunosy	11,600	733.00	8,502,800
デザインワン・ジャパン	2,100	130.00	273,000
イー・ガーディアン	5,500	1,612.00	8,866,000
リブセンス	3,800	256.00	972,800
ジャパンマテリアル	44,700	2,529.00	113,046,300
ベクトル	18,000	1,147.00	20,646,000
ウチヤマホールディングス	3,500	394.00	1,379,000
チャーム・ケア・コーポレーション	12,100	1,230.00	14,883,000
キャリアリンク	5,400	2,481.00	13,397,400
IBJ	11,200	680.00	7,616,000
アサンテ	7,300	1,673.00	12,212,900
バリューHR	12,800	1,510.00	19,328,000
M&Aキャピタルパートナーズ	11,800	2,481.00	29,275,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,800	1,029.00	5,968,200
ERIホールディングス	2,100	1,871.00	3,929,100
アビスト	1,200	3,135.00	3,762,000
シグマクシス・ホールディングス	19,700	1,336.00	26,319,200
ウィルグループ	12,100	1,225.00	14,822,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	10,000	142.00	1,420,000
メドピア	12,900	730.00	9,417,000
レアジョブ	1,600	887.00	1,419,200
リクルートホールディングス	1,082,600	5,934.00	6,424,148,400
エラン	19,300	1,031.00	19,898,300
ツガミ	31,900	1,210.00	38,599,000
オークマ	12,600	6,302.00	79,405,200
芝浦機械	14,300	3,570.00	51,051,000
アマダ	229,200	1,562.50	358,125,000
アイダエンジニアリング	33,300	851.00	28,338,300
FUJI	67,600	2,518.00	170,216,800
牧野フライス製作所	15,900	5,930.00	94,287,000
オーエスジー	63,300	2,034.50	128,783,850
ダイジェット工業	800	856.00	684,800
旭ダイヤモンド工業	34,500	884.00	30,498,000
DMG森精機	87,100	2,792.50	243,226,750
ソディック	34,900	745.00	26,000,500
ディスコ	69,200	36,410.00	2,519,572,000
日東工器	7,000	1,924.00	13,468,000
日進工具	13,300	1,101.00	14,643,300
パンチ工業	7,800	418.00	3,260,400

富士ダイス	7,500	675.00	5,062,500
土木管理総合試験所	3,700	346.00	1,280,200
日本郵政	1,718,400	1,304.00	2,240,793,600
ベルシステム24ホールディングス	15,700	1,650.00	25,905,000
鎌倉新書	12,500	575.00	7,187,500
SMN	1,500	313.00	469,500
一蔵	1,000	592.00	592,000
グローバルキッズCOMPANY	1,500	653.00	979,500
エアトリ	10,700	1,852.00	19,816,400
アトラエ	8,600	701.00	6,028,600
ストライク	6,200	4,510.00	27,962,000
ソラスト	40,400	611.00	24,684,400
セラク	4,500	1,263.00	5,683,500
インソース	31,700	872.00	27,642,400
豊田自動織機	121,300	12,200.00	1,479,860,000
豊和工業	4,400	762.00	3,352,800
石川製作所	2,000	1,130.00	2,260,000
リケンNPR	15,700	2,574.00	40,411,800
東洋機械金属	6,500	716.00	4,654,000
津田駒工業	1,500	376.00	564,000
エンシュウ	1,900	682.00	1,295,800
島精機製作所	22,900	1,571.00	35,975,900
オプトラン	23,700	1,615.00	38,275,500
NCホールディングス	1,900	1,930.00	3,667,000
イワキ	9,700	2,132.00	20,680,400
フリーー	13,500	1,338.00	18,063,000
ヤマシンフィルタ	34,600	336.00	11,625,600
日阪製作所	15,700	955.00	14,993,500
やまびこ	23,500	1,519.00	35,696,500
野村マイクロ・サイエンス	4,900	16,070.00	78,743,000
平田機工	6,900	6,580.00	45,402,000
PEGASUS	15,900	460.00	7,314,000
マルマエ	6,200	2,158.00	13,379,600
タツモ	8,600	2,991.00	25,722,600
ナブテスコ	90,100	2,907.50	261,965,750
三井海洋開発	18,200	2,133.00	38,820,600
レオン自動機	16,600	1,568.00	26,028,800
SMC	43,000	82,150.00	3,532,450,000
ホソカワミクロン	9,200	4,140.00	38,088,000
ユニオンツール	6,300	3,455.00	21,766,500
瑞光	10,400	1,888.00	19,635,200
オイレス工業	19,400	2,105.00	40,837,000
日精エー・エス・ビー機械	5,700	4,415.00	25,165,500
サトーホールディングス	20,300	2,185.00	44,355,500
技研製作所	13,500	2,231.00	30,118,500
日本エアテック	6,600	1,236.00	8,157,600
カワタ	2,500	1,089.00	2,722,500
日精樹脂工業	10,700	1,158.00	12,390,600
オカダアイヨン	2,600	2,653.00	6,897,800
ワイエイシイホールディングス	4,800	2,358.00	11,318,400

小松製作所	673,400	3,884.00	2,615,485,600
住友重機械工業	85,000	3,635.00	308,975,000
日立建機	57,300	3,943.00	225,933,900
日工	21,400	720.00	15,408,000
巴工業	5,600	3,785.00	21,196,000
井関農機	13,400	1,112.00	14,900,800
TOWA	16,000	6,990.00	111,840,000
丸山製作所	1,400	2,620.00	3,668,000
北川鉄工所	5,700	1,363.00	7,769,100
シンニッタン	10,400	266.00	2,766,400
ローツェ	7,500	15,000.00	112,500,000
タカキタ	2,600	502.00	1,305,200
クボタ	753,900	2,197.50	1,656,695,250
荏原実業	7,600	2,984.00	22,678,400
東洋エンジニアリング	20,500	777.00	15,928,500
三菱化工機	5,100	3,350.00	17,085,000
月島ホールディングス	19,400	1,393.00	27,024,200
帝国電機製作所	10,200	3,065.00	31,263,000
東京機械製作所	2,100	494.00	1,037,400
新東工業	29,100	1,111.00	32,330,100
澁谷工業	13,500	2,502.00	33,777,000
アイチコーポレーション	20,000	1,125.00	22,500,000
小森コーポレーション	35,400	1,321.00	46,763,400
鶴見製作所	11,000	3,880.00	42,680,000
日本ギア工業	3,100	532.00	1,649,200
酒井重工業	2,000	6,480.00	12,960,000
荏原製作所	59,000	8,760.00	516,840,000
石井鐵工所	900	2,716.00	2,444,400
西島製作所	12,400	2,324.00	28,817,600
北越工業	14,400	2,614.00	37,641,600
ダイキン工業	171,600	24,210.00	4,154,436,000
オルガノ	17,200	5,950.00	102,340,000
トーヨーカネツ	4,900	4,075.00	19,967,500
栗田工業	80,300	5,626.00	451,767,800
椿本チエイン	20,300	4,080.00	82,824,000
大同工業	3,500	752.00	2,632,000
日機装	33,100	1,033.00	34,192,300
木村化工機	11,000	748.00	8,228,000
レイズネクスト	20,100	1,562.00	31,396,200
アネスト岩田	22,200	1,236.00	27,439,200
ダイフク	242,400	2,950.00	715,080,000
サムコ	3,800	4,205.00	15,979,000
加藤製作所	4,000	1,364.00	5,456,000
油研工業	1,200	2,245.00	2,694,000
タダノ	82,700	1,205.00	99,653,500
フジテック	33,600	3,697.00	124,219,200
CKD	39,800	2,629.00	104,634,200
平和	42,500	2,161.00	91,842,500
理想科学工業	11,500	2,848.00	32,752,000
SANKYO	33,000	8,755.00	288,915,000

日本金銭機械	17,300	1,448.00	25,050,400
マースグループホールディングス	7,300	2,693.00	19,658,900
フクシマガリレイ	9,400	5,250.00	49,350,000
オーイズミ	2,900	433.00	1,255,700
ダイコク電機	7,100	3,790.00	26,909,000
竹内製作所	26,100	4,610.00	120,321,000
アマノ	40,800	3,492.00	142,473,600
JUKI	22,300	468.00	10,436,400
サンデン	12,000	199.00	2,388,000
ジャノメ	14,500	690.00	10,005,000
ブラザー工業	191,900	2,348.50	450,677,150
マックス	20,200	3,285.00	66,357,000
モリタホールディングス	24,900	1,590.00	39,591,000
グローリー	34,500	2,948.50	101,723,250
新晃工業	14,400	2,928.00	42,163,200
大和冷機工業	22,000	1,626.00	35,772,000
セガサミーホールディングス	128,300	2,163.00	277,512,900
T P R	18,300	1,833.00	33,543,900
ツバキ・ナカシマ	28,900	753.00	21,761,700
ホシザキ	84,800	5,443.00	461,566,400
大豊工業	12,500	861.00	10,762,500
日本精工	265,900	800.60	212,879,540
NTN	311,500	273.90	85,319,850
ジェイテクト	127,800	1,294.00	165,373,200
不二越	10,600	3,800.00	40,280,000
ミネベアミツミ	250,000	2,965.00	741,250,000
日本トムソン	39,100	581.00	22,717,100
THK	82,900	2,888.50	239,456,650
ユウシン精機	11,400	683.00	7,786,200
前澤給装工業	11,000	1,368.00	15,048,000
イーグル工業	15,900	1,695.00	26,950,500
前澤工業	4,600	997.00	4,586,200
日本ピラー工業	13,300	4,405.00	58,586,500
キッツ	48,100	1,235.00	59,403,500
日立製作所	690,500	11,045.00	7,626,572,500
三菱電機	1,599,100	2,116.00	3,383,695,600
富士電機	87,400	6,275.00	548,435,000
東洋電機製造	2,500	1,019.00	2,547,500
安川電機	156,000	6,037.00	941,772,000
シンフォニア テクノロジー	15,900	2,178.00	34,630,200
明電舎	26,600	2,519.00	67,005,400
オリジン	1,800	1,232.00	2,217,600
山洋電気	6,200	6,330.00	39,246,000
デンヨー	11,000	2,315.00	25,465,000
PHCホールディングス	26,800	1,506.00	40,360,800
KOKUSAI ELECTRIC	55,200	3,125.00	172,500,000
ソシオネクスト	104,000	2,759.50	286,988,000
ベイカレント・コンサルティング	107,400	4,715.00	506,391,000
Orchestra Holdings	3,200	1,035.00	3,312,000

アイモバイル	19,300	441.00	8,511,300
キャリアインデックス	2,700	222.00	599,400
MS-Japan	4,700	1,174.00	5,517,800
船場	1,700	873.00	1,484,100
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,400	2,297.00	108,877,800
フルテック	1,100	1,192.00	1,311,200
グリーンズ	2,900	1,888.00	5,475,200
ツナググループ・ホールディングス	2,300	883.00	2,030,900
GAMEWITH	2,400	317.00	760,800
MS&Consulting	1,000	706.00	706,000
ウェルビー	7,300	839.00	6,124,700
エル・ティー・エス	1,700	2,900.00	4,930,000
ミダックホールディングス	8,800	2,086.00	18,356,800
キュービーネットホールディングス	7,000	1,509.00	10,563,000
RPAホールディングス	19,800	272.00	5,385,600
三櫻工業	21,800	844.00	18,399,200
マキタ	163,800	3,968.00	649,958,400
東芝テック	18,400	2,940.00	54,096,000
芝浦メカトロニクス	8,100	6,200.00	50,220,000
マブチモーター	71,400	2,436.50	173,966,100
ニデック	317,200	5,844.00	1,853,716,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,100	368.00	3,348,800
トレックス・セミコンダクター	7,400	1,763.00	13,046,200
東光高岳	8,600	2,183.00	18,773,800
ダブル・スコープ	41,100	867.00	35,633,700
宮越ホールディングス	6,400	1,052.00	6,732,800
ダイヘン	14,300	6,530.00	93,379,000
ヤーマン	24,800	1,037.00	25,717,600
JVCケンウッド	113,400	751.00	85,163,400
ミマキエンジニアリング	13,600	875.00	11,900,000
I-PEX	10,000	1,651.00	16,510,000
大崎電気工業	31,500	659.00	20,758,500
オムロン	109,700	6,867.00	753,309,900
日東工業	19,300	3,805.00	73,436,500
IDEC	21,300	3,030.00	64,539,000
正興電機製作所	2,600	1,094.00	2,844,400
不二電機工業	1,600	1,190.00	1,904,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	56,100	2,080.00	116,688,000
サクサホールディングス	1,800	2,617.00	4,710,600
メルコホールディングス	4,600	3,475.00	15,985,000
テクノメディカ	3,500	2,075.00	7,262,500
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,400	709.00	3,828,600
日本電気	188,600	8,764.00	1,652,890,400
富士通	132,200	20,740.00	2,741,828,000
沖電気工業	64,900	968.00	62,823,200
岩崎通信機	3,800	762.00	2,895,600
電気興業	6,400	2,347.00	15,020,800
サンケン電気	13,300	7,205.00	95,826,500

ナカヨ	1,200	1,192.00	1,430,400
アイホン	7,800	2,811.00	21,925,800
ルネサスエレクトロニクス	937,600	2,397.00	2,247,427,200
セイコーエプソン	184,400	2,217.50	408,907,000
ワコム	109,200	691.00	75,457,200
アルバック	34,200	6,725.00	229,995,000
アクセル	5,000	2,268.00	11,340,000
E I Z O	10,600	5,020.00	53,212,000
ジャパンディスプレイ	619,400	21.00	13,007,400
日本信号	32,700	980.00	32,046,000
京三製作所	30,100	470.00	14,147,000
能美防災	19,400	2,207.00	42,815,800
ホーチキ	10,800	1,828.00	19,742,400
星和電機	3,500	486.00	1,701,000
エレコム	34,400	1,713.00	58,927,200
パナソニック ホールディングス	1,697,200	1,459.50	2,477,063,400
シャープ	242,200	1,070.50	259,275,100
アンリツ	101,200	1,351.50	136,771,800
富士通ゼネラル	40,700	2,311.00	94,057,700
ソニーグループ	1,006,300	14,340.00	14,430,342,000
TDK	227,500	6,848.00	1,557,920,000
帝国通信工業	6,200	1,981.00	12,282,200
タムラ製作所	57,300	573.00	32,832,900
アルプスアルパイン	128,200	1,291.00	165,506,200
池上通信機	2,500	884.00	2,210,000
日本電波工業	17,200	1,216.00	20,915,200
鈴木	7,700	1,142.00	8,793,400
メイコー	14,200	4,175.00	59,285,000
日本トリム	3,300	3,025.00	9,982,500
ローランド ディー. ジー.	7,800	3,670.00	28,626,000
フォスター電機	10,700	1,066.00	11,406,200
SMK	3,800	2,627.00	9,982,600
ヨコオ	12,700	1,459.00	18,529,300
ティアック	12,800	98.00	1,254,400
ホシデン	32,600	1,760.00	57,376,000
ヒロセ電機	21,300	17,695.00	376,903,500
日本航空電子工業	34,400	3,155.00	108,532,000
T O A	16,400	1,110.00	18,204,000
マクセル	31,700	1,619.00	51,322,300
古野電気	18,700	1,883.00	35,212,100
スミダコーポレーション	19,200	1,179.00	22,636,800
アイコム	5,500	3,620.00	19,910,000
リオン	5,900	2,271.00	13,398,900
横河電機	157,200	2,890.00	454,308,000
新電元工業	5,500	3,120.00	17,160,000
アズビル	97,800	5,054.00	494,281,200
東亜ディーケーケー	3,700	913.00	3,378,100
日本光電工業	61,000	4,708.00	287,188,000
チノー	5,900	2,382.00	14,053,800
共和電業	7,400	398.00	2,945,200

日本電子材料	8,700	1,739.00	15,129,300
堀場製作所	27,200	11,290.00	307,088,000
アドバンテスト	407,500	5,057.00	2,060,727,500
小野測器	3,300	449.00	1,481,700
エスペック	11,400	2,456.00	27,998,400
キーエンス	142,300	65,620.00	9,337,726,000
日置電機	6,700	6,380.00	42,746,000
シスメックス	122,700	8,427.00	1,033,992,900
日本マイクロニクス	25,500	3,920.00	99,960,000
メガチップス	11,200	4,945.00	55,384,000
OBARA GROUP	7,800	3,915.00	30,537,000
IMAGICA GROUP	14,200	619.00	8,789,800
澤藤電機	900	1,248.00	1,123,200
デンソー	1,173,700	2,280.50	2,676,622,850
原田工業	3,500	766.00	2,681,000
コーセル	17,100	1,344.00	22,982,400
イリソ電子工業	13,100	3,565.00	46,701,500
オブテックスグループ	26,100	1,744.00	45,518,400
千代田インテグレ	5,600	2,850.00	15,960,000
レーザーテック	65,200	34,770.00	2,267,004,000
スタンレー電気	91,000	2,772.00	252,252,000
ウシオ電機	72,200	2,042.50	147,468,500
岡谷電機産業	6,100	291.00	1,775,100
ヘリオス テクノ ホールディング	7,900	551.00	4,352,900
エノモト	2,200	1,598.00	3,515,600
日本セラミック	11,600	2,759.00	32,004,400
遠藤照明	3,500	1,300.00	4,550,000
古河電池	10,500	887.00	9,313,500
双信電機	3,200	305.00	976,000
山一電機	12,800	1,990.00	25,472,000
図研	12,400	4,100.00	50,840,000
日本電子	35,600	6,256.00	222,713,600
カシオ計算機	102,800	1,252.00	128,705,600
ファナック	693,700	4,307.00	2,987,765,900
日本シイエムケイ	30,200	804.00	24,280,800
エンプラス	4,200	13,330.00	55,986,000
大真空	21,200	904.00	19,164,800
ローム	263,000	2,662.00	700,106,000
浜松ホトニクス	114,200	6,058.00	691,823,600
三井ハイテック	12,600	7,085.00	89,271,000
新光電気工業	50,200	5,483.00	275,246,600
京セラ	884,000	2,162.50	1,911,650,000
協栄産業	800	2,442.00	1,953,600
太陽誘電	69,300	3,691.00	255,786,300
村田製作所	1,294,200	2,987.50	3,866,422,500
双葉電子工業	27,200	534.00	14,524,800
日東電工	91,700	11,020.00	1,010,534,000
北陸電気工業	2,900	1,394.00	4,042,600
東海理化電機製作所	40,200	2,335.00	93,867,000
ニチコン	37,300	1,305.00	48,676,500

日本ケミコン	15,200	1,337.00	20,322,400
KOA	21,600	1,558.00	33,652,800
三井E&S	67,900	743.00	50,449,700
日立造船	126,700	956.00	121,125,200
三菱重工業	251,300	9,164.00	2,302,913,200
川崎重工業	116,100	3,287.00	381,620,700
IHI	107,000	2,823.00	302,061,000
名村造船所	30,900	1,206.00	37,265,400
サノヤスホールディングス	11,700	139.00	1,626,300
スプリックス	2,300	844.00	1,941,200
マネジメントソリューションズ	6,200	3,070.00	19,034,000
プロレド・パートナーズ	3,500	359.00	1,256,500
and factory	2,400	337.00	808,800
テノ.ホールディングス	900	524.00	471,600
フロンティア・マネジメント	3,700	1,418.00	5,246,600
ピアラ	1,600	289.00	462,400
コプロ・ホールディングス	2,600	1,591.00	4,136,600
ギークス	1,000	500.00	500,000
アンビスホールディングス	15,700	3,055.00	47,963,500
カーブスホールディングス	40,000	726.00	29,040,000
フォーラムエンジニアリング	19,900	840.00	16,716,000
FAST FITNESS JAPAN	5,000	1,098.00	5,490,000
日本車輛製造	4,700	2,145.00	10,081,500
三菱ロジスネクスト	22,700	1,438.00	32,642,600
近畿車輛	1,000	1,920.00	1,920,000
一家ホールディングス	2,100	678.00	1,423,800
フルサト・マルカホールディングス	13,400	2,581.00	34,585,400
ヤマエグループホールディングス	8,500	4,140.00	35,190,000
ジャパントラフトホールディングス	4,900	168.00	823,200
FPG	47,400	1,734.00	82,191,600
島根銀行	2,200	525.00	1,155,000
じもとホールディングス	6,900	548.00	3,781,200
全国保証	36,600	5,444.00	199,250,400
めぶきフィナンシャルグループ	695,200	438.80	305,053,760
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,000	4,115.00	74,070,000
九州フィナンシャルグループ	271,100	838.00	227,181,800
かんぼ生命保険	142,700	2,627.00	374,872,900
ゆうちょ銀行	1,539,500	1,455.50	2,240,742,250
あんしん保証	3,500	249.00	871,500
富山第一銀行	44,400	772.00	34,276,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	751,600	672.50	505,451,000
ジェイリース	3,700	2,136.00	7,903,200
西日本フィナンシャルホールディングス	79,000	1,639.00	129,481,000
イントラスト	2,900	821.00	2,380,900
日本モーゲージサービス	4,400	526.00	2,314,400
CASA	3,100	898.00	2,783,800
SBIアルヒ	13,400	862.00	11,550,800

プレミアグループ	23,600	1,816.00	42,857,600
日産自動車	2,020,800	581.30	1,174,691,040
いすゞ自動車	413,600	1,955.50	808,794,800
トヨタ自動車	7,811,000	2,844.00	22,214,484,000
日野自動車	213,900	496.80	106,265,520
三菱自動車工業	554,900	468.00	259,693,200
エフテック	5,500	665.00	3,657,500
レシップホールディングス	3,500	680.00	2,380,000
GMB	1,600	1,237.00	1,979,200
ファルテック	1,500	551.00	826,500
武蔵精密工業	34,800	1,616.00	56,236,800
日産車体	16,800	1,012.00	17,001,600
新明和工業	41,000	1,193.00	48,913,000
極東開発工業	23,500	1,993.00	46,835,500
トピー工業	11,500	2,702.00	31,073,000
ティラド	3,200	3,445.00	11,024,000
曙ブレーキ工業	86,900	112.00	9,732,800
タチエス	26,200	1,905.00	49,911,000
NOK	55,200	2,014.00	111,172,800
フタバ産業	38,000	844.00	32,072,000
カヤバ	13,700	5,160.00	70,692,000
市光工業	25,500	587.00	14,968,500
大同メタル工業	27,800	553.00	15,373,400
プレス工業	56,700	605.00	34,303,500
ミクニ	10,000	470.00	4,700,000
太平洋工業	32,600	1,380.00	44,988,000
河西工業	12,600	201.00	2,532,600
アイシン	109,700	5,310.00	582,507,000
マツダ	470,400	1,713.50	806,030,400
今仙電機製作所	5,100	680.00	3,468,000
本田技研工業	3,468,900	1,568.50	5,440,969,650
スズキ	261,300	6,370.00	1,664,481,000
SUBARU	441,100	2,871.00	1,266,398,100
安永	3,500	675.00	2,362,500
ヤマハ発動機	614,700	1,329.50	817,243,650
小糸製作所	147,400	2,264.00	333,713,600
TBK	8,600	395.00	3,397,000
エクセディ	23,300	2,707.00	63,073,100
ミツバ	26,600	1,059.00	28,169,400
豊田合成	41,500	2,810.00	116,615,000
愛三工業	23,600	1,252.00	29,547,200
盟和産業	1,100	1,014.00	1,115,400
日本プラスト	6,600	540.00	3,564,000
ヨロズ	13,300	887.00	11,797,100
エフ・シー・シー	25,100	1,850.00	46,435,000
新家工業	1,800	2,941.00	5,293,800
シマノ	57,800	22,670.00	1,310,326,000
テイ・エス テック	50,600	1,821.00	92,142,600
三十三フィナンシャルグループ	12,600	1,881.00	23,700,600
第四北越フィナンシャルグループ	22,000	3,955.00	87,010,000

ひろぎんホールディングス	199,400	953.00	190,028,200
マーキュリアホールディングス	4,000	708.00	2,832,000
おきなわフィナンシャルグループ	11,900	2,374.00	28,250,600
ダイレクトマーケティングミックス	15,200	455.00	6,916,000
ポピンズ	2,200	1,180.00	2,596,000
LITALICO	11,400	1,969.00	22,446,600
コンフィデンス・インターワークス	500	1,544.00	772,000
十六フィナンシャルグループ	18,200	3,835.00	69,797,000
北國フィナンシャルホールディングス	14,700	4,680.00	68,796,000
ネットプロテクションズホールディングス	46,400	200.00	9,280,000
プロクレアホールディングス	16,100	1,892.00	30,461,200
FPパートナー	2,700	5,250.00	14,175,000
あいちフィナンシャルグループ	21,600	2,505.00	54,108,000
ジャムコ	6,000	1,600.00	9,600,000
小野建	14,800	1,807.00	26,743,600
はるやまホールディングス	4,000	603.00	2,412,000
南陽	1,700	2,182.00	3,709,400
ノジマ	43,600	1,801.00	78,523,600
佐島電機	7,400	2,135.00	15,799,000
カップ・クリエイト	23,700	1,750.00	41,475,000
エコートレーディング	1,600	1,380.00	2,208,000
伯東	8,600	5,900.00	50,740,000
コンドーテック	11,500	1,191.00	13,696,500
中山福	4,800	374.00	1,795,200
ライトオン	6,300	446.00	2,809,800
ナガイレーベン	19,000	2,504.00	47,576,000
三菱食品	13,900	4,895.00	68,040,500
良品計画	164,200	2,460.50	404,014,100
パリミキホールディングス	10,500	511.00	5,365,500
松田産業	11,400	2,472.00	28,180,800
第一興商	58,200	2,121.00	123,442,200
メディopalホールディングス	155,900	2,433.00	379,304,700
アドヴァングループ	14,300	1,070.00	15,301,000
SPK	6,600	1,951.00	12,876,600
萩原電気ホールディングス	6,400	4,795.00	30,688,000
アルビス	5,000	2,675.00	13,375,000
アズワン	23,600	5,528.00	130,460,800
スズデン	5,300	2,481.00	13,149,300
尾家産業	2,000	1,791.00	3,582,000
シモジマ	10,400	1,336.00	13,894,400
ドウシシャ	13,900	2,121.00	29,481,900
小津産業	1,900	1,617.00	3,072,300
コナカ	9,100	413.00	3,758,300
高速	8,900	2,138.00	19,028,200
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,619.00	1,619,000
G-7ホールディングス	16,400	1,240.00	20,336,000
たけびし	5,800	1,965.00	11,397,000
イオン北海道	44,400	935.00	41,514,000
コジマ	24,900	781.00	19,446,900

ヒマラヤ	2,600	943.00	2,451,800
コーナン商事	18,500	4,010.00	74,185,000
ネットワンシステムズ	57,600	2,379.50	137,059,200
エコス	5,600	2,453.00	13,736,800
ワタミ	16,000	1,038.00	16,608,000
マルシェ	2,900	249.00	722,100
リックス	2,600	3,545.00	9,217,000
システムソフト	49,800	61.00	3,037,800
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	303,900	3,255.00	989,194,500
丸文	13,400	1,631.00	21,855,400
西松屋チェーン	29,600	2,078.00	61,508,800
ゼンショーホールディングス	76,600	7,242.00	554,737,200
ハピネット	12,800	2,833.00	36,262,400
幸楽苑ホールディングス	11,200	1,271.00	14,235,200
ハークスレイ	2,900	841.00	2,438,900
橋本総業ホールディングス	5,900	1,332.00	7,858,800
日本ライフライン	44,000	1,315.00	57,860,000
サイゼリヤ	22,300	5,260.00	117,298,000
タカショー	13,200	577.00	7,616,400
VTホールディングス	57,200	527.00	30,144,400
アルゴグラフィックス	13,100	3,860.00	50,566,000
魚力	5,300	2,325.00	12,322,500
I D O M	39,900	960.00	38,304,000
日本エム・ディ・エム	11,300	765.00	8,644,500
ポブラ	2,200	194.00	426,800
フジ・コーポレーション	7,400	1,707.00	12,631,800
ユナイテッドアローズ	17,600	1,889.00	33,246,400
進和	9,200	2,481.00	22,825,200
エスケイジャパン	2,100	824.00	1,730,400
ダイトロン	5,900	2,838.00	16,744,200
ハイデイ日高	22,300	2,911.00	64,915,300
シークス	21,500	1,490.00	32,035,000
YU-WA CREATION HOLDINGS	4,600	154.00	708,400
コロワイド	64,800	2,339.00	151,567,200
田中商事	2,400	799.00	1,917,600
オーハシテクニカ	8,000	1,897.00	15,176,000
壺番屋	11,900	5,760.00	68,544,000
白銅	4,400	2,394.00	10,533,600
トップカルチャー	2,400	158.00	379,200
P L A N T	1,900	1,491.00	2,832,900
スギホールディングス	30,300	6,662.00	201,858,600
ダイコー通産	800	1,205.00	964,000
薬王堂ホールディングス	7,400	2,625.00	19,425,000
島津製作所	188,900	4,215.00	796,213,500
J M S	13,200	516.00	6,811,200
クボテック	2,200	257.00	565,400
長野計器	10,400	2,085.00	21,684,000
ブイ・テクノロジー	7,500	2,806.00	21,045,000

スター精密	26,700	1,768.00	47,205,600
東京計器	10,900	1,761.00	19,194,900
愛知時計電機	6,100	2,455.00	14,975,500
インターアクション	6,700	1,064.00	7,128,800
オーバル	7,000	503.00	3,521,000
東京精密	29,100	9,066.00	263,820,600
マニー	56,900	2,233.50	127,086,150
ニコン	205,600	1,481.00	304,493,600
トプコン	69,200	1,592.00	110,166,400
オリンパス	875,600	2,167.50	1,897,863,000
理研計器	10,100	6,640.00	67,064,000
SCREENホールディングス	48,600	12,150.00	590,490,000
キャノン電子	15,800	2,085.00	32,943,000
タムロン	8,700	5,500.00	47,850,000
HOYA	280,000	17,740.00	4,967,200,000
シード	4,000	840.00	3,360,000
ノーリツ鋼機	13,500	3,150.00	42,525,000
A&Dホロンホールディングス	20,700	1,830.00	37,881,000
朝日インテック	158,900	2,991.50	475,349,350
キャノン	709,500	3,746.00	2,657,787,000
リコー	356,600	1,163.00	414,725,800
シチズン時計	130,900	894.00	117,024,600
リズム	1,800	2,962.00	5,331,600
大研医器	6,700	511.00	3,423,700
メニコン	48,900	2,394.50	117,091,050
シンシア	900	535.00	481,500
KYORITSU	11,700	192.00	2,246,400
中本パックス	2,600	1,688.00	4,388,800
スノーピーク	20,200	920.00	18,584,000
パラマウントベッドホールディングス	29,600	2,803.00	82,968,800
トランザクション	9,400	2,220.00	20,868,000
粧美堂	2,100	673.00	1,413,300
ニホンフラッシュ	13,300	927.00	12,329,100
前田工織	12,000	3,225.00	38,700,000
永大産業	9,200	232.00	2,134,400
アートネイチャー	12,900	809.00	10,436,100
バンダイナムコホールディングス	389,700	2,996.50	1,167,736,050
アイフィスジャパン	2,200	614.00	1,350,800
SHOEI	32,200	1,949.00	62,757,800
フランスベッドホールディングス	18,400	1,412.00	25,980,800
マーベラス	23,100	747.00	17,255,700
パイロットコーポレーション	20,000	4,166.00	83,320,000
萩原工業	9,500	1,507.00	14,316,500
エイベックス	24,300	1,416.00	34,408,800
フジシールインターナショナル	28,900	1,744.00	50,401,600
タカラトミー	64,800	2,420.00	156,816,000
広済堂ホールディングス	32,000	806.00	25,792,000
エステールホールディングス	2,000	636.00	1,272,000
レック	18,300	1,046.00	19,141,800
タカノ	2,900	979.00	2,839,100

三光合成	18,000	516.00	9,288,000
プロネクス	14,700	1,303.00	19,154,100
ホクシン	6,100	115.00	701,500
ウッドワン	2,800	1,042.00	2,917,600
きもと	13,200	226.00	2,983,200
TOPPANホールディングス	174,800	4,110.00	718,428,000
大日本印刷	155,500	4,261.00	662,585,500
共同印刷	4,000	3,340.00	13,360,000
NISSHA	24,400	1,569.00	38,283,600
光村印刷	600	1,556.00	933,600
藤森工業	11,300	3,910.00	44,183,000
ヴィア・ホールディングス	12,500	184.00	2,300,000
TAKARA & COMPANY	9,100	2,695.00	24,524,500
前澤化成工業	9,200	1,585.00	14,582,000
未来工業	5,100	3,535.00	18,028,500
アシックス	121,100	4,388.00	531,386,800
ツツミ	2,400	2,325.00	5,580,000
ウェーブロックホールディングス	2,900	654.00	1,896,600
JSP	10,100	1,924.00	19,432,400
ニチハ	17,900	2,997.00	53,646,300
ローランド	10,500	4,750.00	49,875,000
エフピコ	27,100	2,988.00	80,974,800
小松ウオール工業	5,800	2,987.00	17,324,600
ヤマハ	89,700	3,422.00	306,953,400
河合楽器製作所	4,400	3,560.00	15,664,000
クリナップ	13,900	711.00	9,882,900
ピジョン	90,600	1,652.50	149,716,500
天馬	10,400	2,269.00	23,597,600
キングジム	12,600	884.00	11,138,400
象印マホービン	38,600	1,523.00	58,787,800
リンテック	28,500	2,701.00	76,978,500
信越ポリマー	30,700	1,653.00	50,747,100
東リ	19,500	330.00	6,435,000
イトーキ	29,200	1,360.00	39,712,000
任天堂	898,100	7,930.00	7,121,933,000
三菱鉛筆	20,100	2,063.00	41,466,300
松風	6,400	2,792.00	17,868,800
タカラスタンダード	29,900	1,708.00	51,069,200
コクヨ	58,200	2,369.50	137,904,900
ナカバヤシ	15,400	560.00	8,624,000
ニフコ	42,700	3,902.00	166,615,400
立川ブラインド工業	6,600	1,473.00	9,721,800
グローブライド	12,800	2,022.00	25,881,600
オカムラ	42,900	2,169.00	93,050,100
バルカー	11,900	4,175.00	49,682,500
MUTOHホールディングス	1,000	2,078.00	2,078,000
伊藤忠商事	1,011,800	6,365.00	6,440,107,000
丸紅	1,254,800	2,399.50	3,010,892,600
スクロール	22,400	1,005.00	22,512,000
高島	5,700	1,231.00	7,016,700

ヨンドシーホールディングス	14,200	2,017.00	28,641,400
三陽商会	4,700	2,495.00	11,726,500
長瀬産業	68,900	2,350.50	161,949,450
ナイガイ	2,600	268.00	696,800
蝶理	9,400	2,931.00	27,551,400
豊田通商	131,800	9,315.00	1,227,717,000
オンワードホールディングス	84,000	508.00	42,672,000
三共生興	20,900	737.00	15,403,300
兼松	62,900	2,198.00	138,254,200
美津濃	14,100	4,095.00	57,739,500
ツカモトコーポレーション	1,100	1,267.00	1,393,700
ルックホールディングス	3,500	2,388.00	8,358,000
三井物産	1,134,000	5,693.00	6,455,862,000
日本紙パルプ商事	7,200	5,020.00	36,144,000
東京エレクトロン	301,000	26,080.00	7,850,080,000
カメイ	16,000	1,836.00	29,376,000
東都水産	400	7,200.00	2,880,000
OUGホールディングス	1,200	2,449.00	2,938,800
スターゼン	10,400	2,724.00	28,329,600
セイコーグループ	19,800	2,707.00	53,598,600
山善	45,700	1,193.00	54,520,100
椿本興業	3,100	6,870.00	21,297,000
住友商事	910,900	3,256.00	2,965,890,400
BIPROGY	46,700	4,370.00	204,079,000
内田洋行	6,100	7,090.00	43,249,000
三菱商事	2,982,300	2,371.50	7,072,524,450
第一実業	14,100	1,988.00	28,030,800
キャノンマーケティングジャパン	34,900	4,177.00	145,777,300
西華産業	5,900	2,990.00	17,641,000
佐藤商事	10,600	1,555.00	16,483,000
菱洋エレクトロ	14,200	3,750.00	53,250,000
東京産業	13,700	852.00	11,672,400
ユアサ商事	11,700	4,825.00	56,452,500
神鋼商事	3,800	5,920.00	22,496,000
トルク	4,600	269.00	1,237,400
阪和興業	27,100	5,210.00	141,191,000
正栄食品工業	10,100	4,755.00	48,025,500
カナデン	11,300	1,598.00	18,057,400
RYODEN	12,100	2,754.00	33,323,400
ニプロ	118,500	1,166.50	138,230,250
岩谷産業	34,300	6,660.00	228,438,000
ナイス	2,600	1,698.00	4,414,800
ニチモウ	2,400	2,114.00	5,073,600
極東貿易	8,900	2,084.00	18,547,600
アステナホールディングス	28,300	484.00	13,697,200
三愛オブリ	36,100	1,680.00	60,648,000
稲畑産業	29,800	3,070.00	91,486,000
GSIクレオス	8,000	2,270.00	18,160,000
明和産業	17,900	669.00	11,975,100
クワザワホールディングス	3,100	683.00	2,117,300

キムラタン	51,400	18.00	925,200
ゴールドウイン	25,200	10,265.00	258,678,000
ユニ・チャーム	297,300	5,247.00	1,559,933,100
デサント	24,500	3,925.00	96,162,500
キング	2,900	701.00	2,032,900
ワキタ	24,900	1,600.00	39,840,000
ヤマトインターナショナル	6,200	318.00	1,971,600
東邦ホールディングス	41,600	3,266.00	135,865,600
サンゲツ	34,700	3,210.00	111,387,000
ミツウロコグループホールディングス	19,200	1,636.00	31,411,200
シナネンホールディングス	4,200	4,275.00	17,955,000
伊藤忠エネクス	37,300	1,651.00	61,582,300
サンリオ	42,700	6,277.00	268,027,900
サンワテクノス	7,700	2,269.00	17,471,300
リョーサン	10,700	4,875.00	52,162,500
新光商事	20,200	1,205.00	24,341,000
トーヨー	5,800	2,760.00	16,008,000
三信電気	6,000	2,350.00	14,100,000
東陽テクニカ	15,400	1,470.00	22,638,000
モスフードサービス	22,200	3,380.00	75,036,000
加賀電子	13,700	6,430.00	88,091,000
三益半導体工業	11,300	3,235.00	36,555,500
都築電気	7,500	2,273.00	17,047,500
ソーダニッカ	11,100	1,170.00	12,987,000
立花エレテック	10,100	2,916.00	29,451,600
木曽路	22,800	2,637.00	60,123,600
SRSホールディングス	24,800	1,146.00	28,420,800
千趣会	27,700	338.00	9,362,600
タカキュー	5,800	89.00	516,200
リテールパートナーズ	22,300	1,685.00	37,575,500
上新電機	14,800	2,465.00	36,482,000
日本瓦斯	79,700	2,409.00	191,997,300
ロイヤルホールディングス	26,500	2,583.00	68,449,500
東天紅	600	842.00	505,200
いなげや	14,100	1,322.00	18,640,200
チヨダ	14,400	878.00	12,643,200
ライフコーポレーション	15,800	3,485.00	55,063,000
リンガーハット	19,400	2,416.00	46,870,400
MrMaxHD	19,000	645.00	12,255,000
テンアライド	10,900	315.00	3,433,500
AOKIホールディングス	32,200	1,169.00	37,641,800
オークワ	21,700	873.00	18,944,100
コメリ	23,100	3,245.00	74,959,500
青山商事	32,200	1,594.00	51,326,800
しまむら	17,600	16,360.00	287,936,000
はせがわ	4,000	371.00	1,484,000
高島屋	104,000	2,017.00	209,768,000
松屋	25,500	953.00	24,301,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	66,500	1,597.00	106,200,500
近鉄百貨店	6,400	2,652.00	16,972,800

丸井グループ	100,000	2,470.00	247,000,000
クレディセゾン	88,800	2,738.00	243,134,400
アクシアル リテイリング	10,300	4,100.00	42,230,000
井筒屋	4,000	373.00	1,492,000
イオン	510,200	3,328.00	1,697,945,600
イズミ	26,700	3,607.00	96,306,900
フォーバル	5,900	1,434.00	8,460,600
平和堂	25,100	2,180.00	54,718,000
フジ	23,100	1,902.00	43,936,200
ヤオコー	17,000	8,385.00	142,545,000
ゼビオホールディングス	20,300	969.00	19,670,700
ケーズホールディングス	106,400	1,347.50	143,374,000
PAL TAC	20,200	4,648.00	93,889,600
三谷産業	26,400	385.00	10,164,000
O l y m p i c グループ	3,600	553.00	1,990,800
日産東京販売ホールディングス	12,500	463.00	5,787,500
あおぞら銀行	100,700	3,146.00	316,802,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,530,900	1,281.00	10,928,082,900
りそなホールディングス	1,633,700	751.70	1,228,052,290
三井住友トラスト・ホールディングス	503,400	2,900.00	1,459,860,000
三井住友フィナンシャルグループ	996,100	7,237.00	7,208,775,700
千葉銀行	390,400	1,066.50	416,361,600
群馬銀行	271,800	705.10	191,646,180
武蔵野銀行	19,500	2,727.00	53,176,500
千葉興業銀行	23,100	821.00	18,965,100
筑波銀行	61,300	246.00	15,079,800
七十七銀行	40,800	3,555.00	145,044,000
秋田銀行	9,400	1,940.00	18,236,000
山形銀行	15,600	1,097.00	17,113,200
岩手銀行	8,800	2,582.00	22,721,600
東邦銀行	110,900	296.00	32,826,400
東北銀行	3,800	1,185.00	4,503,000
ふくおかフィナンシャルグループ	122,000	3,458.00	421,876,000
スルガ銀行	123,500	845.00	104,357,500
八十二銀行	300,600	783.50	235,520,100
山梨中央銀行	15,700	1,734.00	27,223,800
大垣共立銀行	26,700	1,884.00	50,302,800
福井銀行	12,600	1,700.00	21,420,000
清水銀行	5,600	1,555.00	8,708,000
富山銀行	1,400	1,730.00	2,422,000
滋賀銀行	23,400	3,500.00	81,900,000
南都銀行	21,200	2,527.00	53,572,400
百五銀行	131,700	554.00	72,961,800
紀陽銀行	50,100	1,644.00	82,364,400
ほくほくフィナンシャルグループ	86,700	1,552.00	134,558,400
山陰合同銀行	87,700	1,030.00	90,331,000
鳥取銀行	2,700	1,400.00	3,780,000
百十四銀行	13,700	2,428.00	33,263,600
四国銀行	20,500	991.00	20,315,500
阿波銀行	19,600	2,465.00	48,314,000

大分銀行	8,400	2,615.00	21,966,000
宮崎銀行	8,400	2,678.00	22,495,200
佐賀銀行	8,200	1,909.00	15,653,800
琉球銀行	29,800	1,129.00	33,644,200
セブン銀行	439,100	307.70	135,111,070
みずほフィナンシャルグループ	1,891,100	2,551.00	4,824,196,100
高知銀行	2,600	918.00	2,386,800
山口フィナンシャルグループ	137,300	1,338.00	183,707,400
芙蓉総合リース	12,900	12,950.00	167,055,000
みずほリース	23,500	5,150.00	121,025,000
東京センチュリー	104,800	1,627.50	170,562,000
SBIホールディングス	205,000	3,530.00	723,650,000
日本証券金融	51,500	1,563.00	80,494,500
アイフル	206,200	392.00	80,830,400
日本アジア投資	5,700	262.00	1,493,400
名古屋銀行	9,100	5,370.00	48,867,000
北洋銀行	212,200	355.00	75,331,000
大光銀行	2,500	1,300.00	3,250,000
愛媛銀行	18,900	1,040.00	19,656,000
トマト銀行	2,800	1,186.00	3,320,800
京葉銀行	58,800	703.00	41,336,400
栃木銀行	70,100	307.00	21,520,700
北日本銀行	4,600	2,164.00	9,954,400
東和銀行	25,600	620.00	15,872,000
福島銀行	8,200	244.00	2,000,800
大東銀行	3,400	768.00	2,611,200
リコーリース	13,300	4,850.00	64,505,000
イオンフィナンシャルサービス	80,300	1,337.50	107,401,250
アコム	250,200	360.90	90,297,180
ジャックス	14,800	5,450.00	80,660,000
オリエントコーポレーション	45,700	1,094.00	49,995,800
オリックス	853,900	2,801.00	2,391,773,900
三菱HCキャピタル	624,200	998.30	623,138,860
ジャフコグループ	41,700	1,721.50	71,786,550
九州リースサービス	3,100	1,082.00	3,354,200
トモニホールディングス	113,300	382.00	43,280,600
大和証券グループ本社	1,085,300	1,033.50	1,121,657,550
野村ホールディングス	2,356,200	693.80	1,634,731,560
岡三証券グループ	123,100	751.00	92,448,100
丸三証券	46,600	892.00	41,567,200
東洋証券	37,200	302.00	11,234,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	166,300	559.00	92,961,700
光世証券	1,800	529.00	952,200
水戸証券	41,400	459.00	19,002,600
いちよし証券	26,300	761.00	20,014,300
松井証券	68,900	782.00	53,879,800
SOMPOホールディングス	210,700	7,303.00	1,538,742,100
日本取引所グループ	365,500	3,161.00	1,155,345,500
マネックスグループ	137,200	755.00	103,586,000

極東証券	19,200	1,046.00	20,083,200
岩井コスモホールディングス	16,000	1,921.00	30,736,000
アイザワ証券グループ	20,200	1,334.00	26,946,800
フィデアホールディングス	14,400	1,564.00	22,521,600
池田泉州ホールディングス	194,000	327.00	63,438,000
アニコムホールディングス	47,500	555.00	26,362,500
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	313,700	5,803.00	1,820,401,100
マネーパートナーズグループ	8,100	293.00	2,373,300
スパークス・グループ	15,700	1,690.00	26,533,000
小林洋行	2,900	247.00	716,300
第一生命ホールディングス	684,600	3,114.00	2,131,844,400
東京海上ホールディングス	1,384,900	3,690.00	5,110,281,000
アドバンテッジリスクマネジメント	4,200	481.00	2,020,200
イー・ギャランティ	22,800	2,005.00	45,714,000
アサックス	3,500	733.00	2,565,500
NECキャピタルソリューション	6,900	3,525.00	24,322,500
T&Dホールディングス	376,100	2,361.00	887,972,100
アドバンスクリエイト	8,100	1,024.00	8,294,400
三井不動産	647,900	3,750.00	2,429,625,000
三菱地所	915,900	2,089.50	1,913,773,050
平和不動産	22,700	3,925.00	89,097,500
東京建物	122,400	2,265.50	277,297,200
京阪神ビルディング	26,200	1,400.00	36,680,000
住友不動産	202,600	4,495.00	910,687,000
太平洋興発	3,100	825.00	2,557,500
テーオーシー	25,000	737.00	18,425,000
東京楽天地	2,200	6,720.00	14,784,000
レオパレス21	140,100	421.00	58,982,100
スターツコーポレーション	20,000	3,035.00	60,700,000
フジ住宅	17,600	728.00	12,812,800
空港施設	19,700	600.00	11,820,000
明和地所	7,000	1,329.00	9,303,000
ゴールドクレスト	11,400	2,312.00	26,356,800
リログループ	73,300	1,676.50	122,887,450
エスリード	6,500	3,645.00	23,692,500
日神グループホールディングス	22,600	520.00	11,752,000
日本エスコン	26,200	961.00	25,178,200
MIRARTHホールディングス	64,400	491.00	31,620,400
AVANTIA	4,400	901.00	3,964,400
イオンモール	72,600	1,817.00	131,914,200
毎日コムネット	2,900	766.00	2,221,400
ファースト住建	3,200	1,095.00	3,504,000
ランド	766,600	8.00	6,132,800
カチタス	37,700	2,085.00	78,604,500
東祥	10,300	884.00	9,105,200
トーセイ	23,400	2,126.00	49,748,400
穴吹興産	1,600	2,041.00	3,265,600
サンフロンティア不動産	20,700	1,774.00	36,721,800
FJネクストホールディングス	14,700	1,180.00	17,346,000

インテリックス	2,000	508.00	1,016,000
ランドビジネス	2,900	270.00	783,000
サンネクスタグループ	2,300	969.00	2,228,700
グランディハウス	9,200	639.00	5,878,800
東武鉄道	156,200	4,037.00	630,579,400
相鉄ホールディングス	50,900	2,808.50	142,952,650
東急	398,800	1,799.50	717,640,600
京浜急行電鉄	175,900	1,346.50	236,849,350
小田急電鉄	235,200	2,323.00	546,369,600
京王電鉄	68,300	4,644.00	317,185,200
京成電鉄	91,700	7,058.00	647,218,600
富士急行	17,500	4,690.00	82,075,000
東日本旅客鉄道	261,400	8,441.00	2,206,477,400
西日本旅客鉄道	168,700	6,109.00	1,030,588,300
東海旅客鉄道	547,900	3,734.00	2,045,858,600
西武ホールディングス	172,100	2,066.00	355,558,600
鴻池運輸	24,200	1,952.00	47,238,400
西日本鉄道	38,000	2,477.50	94,145,000
ハマキョウレックス	12,100	4,220.00	51,062,000
サカイ引越センター	15,800	2,771.00	43,781,800
近鉄グループホールディングス	142,000	4,658.00	661,436,000
阪急阪神ホールディングス	189,400	4,699.00	889,990,600
南海電気鉄道	63,300	2,972.50	188,159,250
京阪ホールディングス	78,300	3,787.00	296,522,100
神戸電鉄	3,900	2,965.00	11,563,500
名古屋鉄道	146,500	2,360.00	345,740,000
山陽電気鉄道	10,700	2,193.00	23,465,100
アルプス物流	11,300	1,772.00	20,023,600
トランコム	4,200	7,190.00	30,198,000
ヤマトホールディングス	181,900	2,646.00	481,307,400
山九	36,100	5,310.00	191,691,000
日新	10,800	2,567.00	27,723,600
丸運	4,500	282.00	1,269,000
丸全昭和運輸	8,700	4,045.00	35,191,500
センコーグループホールディングス	75,200	1,157.00	87,006,400
トナミホールディングス	3,200	4,690.00	15,008,000
ニッコンホールディングス	45,500	3,147.00	143,188,500
日本石油輸送	700	2,989.00	2,092,300
福山通運	16,200	4,245.00	68,769,000
セイノーホールディングス	79,800	2,175.00	173,565,000
エスライングループ本社	2,200	906.00	1,993,200
神奈川中央交通	4,000	3,075.00	12,300,000
AZ-COM丸和ホールディングス	34,400	1,548.00	53,251,200
C&Fロジホールディングス	13,700	1,592.00	21,810,400
日本郵船	407,100	4,641.00	1,889,351,100
商船三井	308,200	4,790.00	1,476,278,000
川崎汽船	120,000	6,420.00	770,400,000
NSユニテッド海運	7,600	4,920.00	37,392,000
明海グループ	8,600	796.00	6,845,600
飯野海運	52,200	1,260.00	65,772,000

共栄タンカー	1,400	865.00	1,211,000
九州旅客鉄道	100,400	3,262.00	327,504,800
SGホールディングス	238,500	2,101.50	501,207,750
NIPPON EXPRESSホールディングス	48,200	8,443.00	406,952,600
ID&Eホールディングス	8,700	3,475.00	30,232,500
日本航空	348,800	2,838.00	989,894,400
ANAホールディングス	386,400	3,200.00	1,236,480,000
ビーウィズ	3,700	2,111.00	7,810,700
パスコ	1,500	1,877.00	2,815,500
TREホールディングス	28,000	1,224.00	34,272,000
人・夢・技術グループ	5,500	1,808.00	9,944,000
西本Wismettacホールディングス	3,800	6,100.00	23,180,000
シルバーライフ	2,800	866.00	2,424,800
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,201.00	1,320,600
Genky Drug Stores	6,500	5,580.00	36,270,000
コア商事ホールディングス	8,400	748.00	6,283,200
KPPグループホールディングス	38,900	692.00	26,918,800
ナルミヤ・インターナショナル	1,400	1,245.00	1,743,000
ブックオフグループホールディングス	7,600	1,184.00	8,998,400
ギフトホールディングス	6,300	2,504.00	15,775,200
三菱倉庫	34,900	4,516.00	157,608,400
三井倉庫ホールディングス	13,300	4,925.00	65,502,500
住友倉庫	38,200	2,593.00	99,052,600
澁澤倉庫	6,400	3,095.00	19,808,000
ヤマタネ	6,600	2,613.00	17,245,800
東陽倉庫	2,100	1,568.00	3,292,800
乾汽船	16,600	1,128.00	18,724,800
日本トランスシティ	28,600	648.00	18,532,800
ケイヒン	1,400	1,793.00	2,510,200
中央倉庫	7,600	1,174.00	8,922,400
川西倉庫	1,500	1,210.00	1,815,000
安田倉庫	9,800	1,244.00	12,191,200
ファイズホールディングス	1,100	1,191.00	1,310,100
NISSOホールディングス	12,700	839.00	10,655,300
大栄環境	26,600	2,566.00	68,255,600
日本管財ホールディングス	15,400	2,618.00	40,317,200
東洋埠頭	2,200	1,399.00	3,077,800
上組	65,600	3,474.00	227,894,400
サンリツ	1,900	777.00	1,476,300
キムラユニティー	3,800	1,425.00	5,415,000
キューソー流通システム	5,700	911.00	5,192,700
東海運	4,800	294.00	1,411,200
エーアイテイー	8,800	1,800.00	15,840,000
内外トランスライン	5,700	2,439.00	13,902,300
ショーエイコーポレーション	2,600	605.00	1,573,000
日本コンセプト	5,200	1,688.00	8,777,600
TBSホールディングス	71,700	3,193.00	228,938,100
日本テレビホールディングス	126,300	1,650.00	208,395,000

朝日放送グループホールディングス	13,300	675.00	8,977,500
テレビ朝日ホールディングス	34,700	1,693.00	58,747,100
スカパーJ SATホールディングス	110,800	717.00	79,443,600
テレビ東京ホールディングス	10,300	3,125.00	32,187,500
日本BS放送	2,800	908.00	2,542,400
ビジョン	21,600	1,216.00	26,265,600
スマートバリュー	1,900	392.00	744,800
USEN-NEXT HOLDINGS	16,000	3,930.00	62,880,000
ワイヤレスゲート	3,600	238.00	856,800
日本通信	140,300	229.00	32,128,700
クロップス	1,000	1,216.00	1,216,000
日本電信電話	42,436,700	180.60	7,664,068,020
KDDI	1,102,500	4,851.00	5,348,227,500
ソフトバンク	2,295,200	1,883.00	4,321,861,600
光通信	14,300	25,380.00	362,934,000
エムティーアイ	9,900	654.00	6,474,600
GMOインターネットグループ	52,700	2,582.00	136,071,400
ファイバーゲート	7,700	911.00	7,014,700
アイドママーケティングコミュニケーション	2,200	243.00	534,600
KADOKAWA	75,500	3,022.00	228,161,000
学研ホールディングス	23,700	1,017.00	24,102,900
ゼンリン	24,300	893.00	21,699,900
昭文社ホールディングス	3,500	362.00	1,267,000
インプレスホールディングス	8,000	182.00	1,456,000
東京電力ホールディングス	1,282,300	797.00	1,021,993,100
中部電力	524,200	1,937.50	1,015,637,500
関西電力	549,300	1,999.50	1,098,325,350
中国電力	247,200	1,052.50	260,178,000
北陸電力	145,400	741.90	107,872,260
東北電力	374,400	985.20	368,858,880
四国電力	132,500	1,070.50	141,841,250
九州電力	327,900	1,061.50	348,065,850
北海道電力	137,400	659.60	90,629,040
沖縄電力	36,300	1,180.00	42,834,000
電源開発	116,800	2,414.00	281,955,200
エフオン	9,200	452.00	4,158,400
イーレックス	25,300	816.00	20,644,800
レノバ	37,900	1,216.00	46,086,400
東京瓦斯	300,700	3,456.00	1,039,219,200
大阪瓦斯	288,200	3,173.00	914,458,600
東邦瓦斯	61,600	3,134.00	193,054,400
北海道瓦斯	8,400	2,305.00	19,362,000
広島ガス	30,100	400.00	12,040,000
西部ガスホールディングス	14,700	2,011.00	29,561,700
静岡ガス	28,400	1,058.00	30,047,200
メタウォーター	17,000	2,117.00	35,989,000
M&A総研ホールディングス	7,000	4,530.00	31,710,000
アイネット	8,600	1,844.00	15,858,400

松竹	7,400	9,861.00	72,971,400
東宝	79,300	4,950.00	392,535,000
エイチ・アイ・エス	42,500	1,825.00	77,562,500
東映	4,800	21,230.00	101,904,000
ラックランド	6,600	2,510.00	16,566,000
NTTデータグループ	373,000	2,091.50	780,129,500
共立メンテナンス	22,900	5,985.00	137,056,500
イチネンホールディングス	15,500	1,601.00	24,815,500
建設技術研究所	7,500	5,440.00	40,800,000
スペース	9,500	941.00	8,939,500
アインホールディングス	20,700	4,618.00	95,592,600
燦ホールディングス	13,700	1,146.00	15,700,200
ピー・シー・エー	8,200	1,165.00	9,553,000
スバル興業	600	15,290.00	9,174,000
東京テアトル	3,100	1,126.00	3,490,600
タナベコンサルティンググループ	4,500	1,052.00	4,734,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,600	2,199.00	12,314,400
ナガワ	4,600	7,810.00	35,926,000
東京都競馬	12,200	4,545.00	55,449,000
常磐興産	3,100	1,253.00	3,884,300
カナモト	22,600	2,818.00	63,686,800
D T S	30,400	3,720.00	113,088,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	65,200	5,555.00	362,186,000
シーイーシー	18,100	1,629.00	29,484,900
カブコン	127,600	5,347.00	682,277,200
ニシオホールディングス	13,600	4,015.00	54,604,000
アイ・エス・ビー	7,300	1,480.00	10,804,000
アゴーラ ホスピタリティー グループ	52,700	23.00	1,212,100
日本空港ビルデング	49,500	6,368.00	315,216,000
トランス・コスモス	18,200	3,175.00	57,785,000
乃村工藝社	63,800	881.00	56,207,800
ジャステック	8,700	1,476.00	12,841,200
S C S K	99,900	2,908.50	290,559,150
藤田観光	5,800	6,000.00	34,800,000
KNT-CTホールディングス	8,700	1,333.00	11,597,100
トーカイ	13,000	2,139.00	27,807,000
白洋舎	1,200	2,394.00	2,872,800
セコム	149,000	10,855.00	1,617,395,000
NSW	6,300	3,025.00	19,057,500
セントラル警備保障	7,900	2,578.00	20,366,200
アイネス	11,100	1,620.00	17,982,000
丹青社	28,300	874.00	24,734,200
メイテックグループホールディングス	52,600	2,956.50	155,511,900
TKC	22,600	3,795.00	85,767,000
富士ソフト	28,800	6,240.00	179,712,000
応用地質	13,600	2,126.00	28,913,600
船井総研ホールディングス	30,400	2,658.00	80,803,200
NSD	50,900	2,816.00	143,334,400

進学会ホールディングス	2,200	253.00	556,600
丸紅建材リース	600	2,787.00	1,672,200
オオバ	5,100	984.00	5,018,400
コナミグループ	53,500	8,410.00	449,935,000
いであ	2,200	1,774.00	3,902,800
学究社	5,800	2,064.00	11,971,200
ベネッセホールディングス	49,100	2,632.50	129,255,750
イオンディライト	15,700	3,610.00	56,677,000
ナック	6,200	1,053.00	6,528,600
福井コンピュータホールディングス	8,700	2,618.00	22,776,600
ダイセキ	29,900	4,330.00	129,467,000
ステップ	5,400	1,986.00	10,724,400
泉州電業	7,500	3,410.00	25,575,000
元気寿司	8,400	3,505.00	29,442,000
トラスコ中山	31,600	2,519.00	79,600,400
ヤマダホールディングス	462,900	454.40	210,341,760
オートバックスセブン	52,400	1,585.50	83,080,200
モリト	10,800	1,330.00	14,364,000
アークランズ	44,700	1,701.00	76,034,700
ニトリホールディングス	54,800	18,060.00	989,688,000
グルメ杵屋	12,100	1,073.00	12,983,300
愛眼	6,200	190.00	1,178,000
ケーユーホールディングス	7,100	1,151.00	8,172,100
吉野家ホールディングス	55,400	3,312.00	183,484,800
加藤産業	18,600	4,700.00	87,420,000
北恵	2,100	880.00	1,848,000
イノテック	9,500	1,827.00	17,356,500
イエローハット	23,900	1,802.00	43,067,800
松屋フーズホールディングス	7,100	5,900.00	41,890,000
J B C Cホールディングス	9,400	3,920.00	36,848,000
J Kホールディングス	11,600	1,080.00	12,528,000
サガミホールディングス	22,600	1,470.00	33,222,000
日伝	10,200	2,920.00	29,784,000
関西フードマーケット	10,300	1,490.00	15,347,000
ミロク情報サービス	13,000	1,811.00	23,543,000
北沢産業	5,100	278.00	1,417,800
杉本商事	7,300	2,291.00	16,724,300
因幡電機産業	38,900	3,495.00	135,955,500
王将フードサービス	11,200	8,180.00	91,616,000
ミニストップ	11,000	1,569.00	17,259,000
アークス	27,600	2,925.00	80,730,000
バローホールディングス	28,800	2,562.00	73,785,600
東テク	5,100	5,060.00	25,806,000
ミスミグループ本社	227,200	2,508.50	569,931,200
アルテック	4,500	244.00	1,098,000
ベルク	7,500	6,300.00	47,250,000
大 庄	6,300	1,270.00	8,001,000
タキヒヨー	2,000	1,018.00	2,036,000
ファーストリテイリング	67,700	36,620.00	2,479,174,000
ソフトバンクグループ	703,700	6,431.00	4,525,494,700

蔵王産業	1,500	2,521.00	3,781,500	
スズケン	57,300	4,848.00	277,790,400	
サンドラッグ	50,800	4,516.00	229,412,800	
サックスパー ホールディングス	12,700	844.00	10,718,800	
ジェコス	8,900	1,098.00	9,772,200	
ヤマザワ	1,800	1,278.00	2,300,400	
やまや	1,700	3,110.00	5,287,000	
グローセル	15,500	679.00	10,524,500	
ベルーナ	36,200	623.00	22,552,600	
合計	220,224,100		501,152,764,250	

(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)

2024年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,017,441,206
国債証券	242,369,186,801
派生商品評価勘定	5,162,869
未収入金	3,258,991,617
未収利息	1,759,614,675
前払費用	211,233,816
流動資産合計	251,621,630,984
資産合計	251,621,630,984
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,760,778
前受金	1,681,132,245
未払金	639,876,965
未払解約金	3,061,975,000
流動負債合計	5,384,744,988
負債合計	5,384,744,988
純資産の部	
元本等	
元本	107,965,110,236
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	138,271,775,760
元本等合計	246,236,885,996
純資産合計	246,236,885,996
負債純資産合計	251,621,630,984

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7月12日 至 2024年1月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	104,763,290,199円
同期中追加設定元本額	22,055,676,474円
同期中一部解約元本額	18,853,856,437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	6,881,223,250円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,145,444円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	13,898,297円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	33,694,653円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	29,803,678円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	42,934,640円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,591,206円
たわらノーロード 先進国債券	19,827,972,931円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	360,154,426円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,096,947,248円
たわらノーロード バランス（堅実型）	69,998,735円
たわらノーロード バランス（標準型）	391,444,624円
たわらノーロード バランス（積極型）	88,758,861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）	17,917,867円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	1,054,059,074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）	1,836,331,443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）	902,250,800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）	684,082,525円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,193,021円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	12,350,592円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	195,919,611円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	17,738,196円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	36,398,791円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,843,987,367円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	1,330,679,699円

One グローバルバランス	50,482,197円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,851,739,673円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	415,782,480円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	801,750,820円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,358,394円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	893,929,925円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,215,627円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	159,329,380円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	160,868,965円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	258,954,767円
クルーズコントロール	995,614,214円
DIAM 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>	805,451,241円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	699,203,724円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,600,769円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	458,147,579円
One グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	5,251,423円
One グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	97,565,533円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	989,890,513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)	222,420,965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)	223,425,556円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	95,585,889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)	133,815,347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)	544,565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)	591,440,828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)	522,061,984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)	197,100,054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)	574,015,166円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,849,417,418円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,382,576,553円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,512,645,740円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,273,590,222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)	214,210,726円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	43,615,125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)	367,355,200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)	319,552,429円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限	204,015,516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)	11,612,607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)	20,232,209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)	6,525,375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)	50,401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)	3,854,304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)	35,206,577円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,284,757,008円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,246,667,206円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,341,671,486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)	52,433,299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)	99,972,653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)	1,161,371,080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)	204,916,647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)	154,175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)	212,900,846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)	260,571,634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)	344,848,371円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	33,913,630円
動的パッケージファンド<DC年金>	48,719,478円
コア資産形成ファンド	25,202,017円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	4,197,854,690円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	10,174,909,884円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,706,467,769円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	4,898,733,380円
計	107,965,110,236円
2. 受益権の総数	107,965,110,236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7月12日 至 2024年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年1月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	3,077,439,791	
合計	3,077,439,791	

(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2024年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年1月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	998,599,000	—	1,000,353,144	△1,754,144
イギリス・ポンド	337,153,000	—	337,167,826	△14,826
オフショア・人民元	42,858,000	—	42,859,639	△1,639
ユーロ	453,496,000	—	455,235,127	△1,739,127
買建	165,092,000	—	165,090,552	1,448
アメリカ・ドル	653,400,000	—	658,556,235	5,156,235
イギリス・ポンド	194,693,000	—	196,021,957	1,328,957
オフショア・人民元	31,564,000	—	31,863,824	299,824
ユーロ	245,126,000	—	246,764,230	1,638,230
	182,017,000	—	183,906,224	1,889,224

合計	1,651,999,000	—	1,658,909,379	3,402,091
----	---------------	---	---------------	-----------

(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)

	2024年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2807円 (22,807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

2024年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/31/25	1,690,000.000	1,592,032.810	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,287,539.080	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,558,492.170	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,352,022.270	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,463,741.400	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,713,593.760	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,260,699.220	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,423,100.000	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,323,520.690	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,330,996.660	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,816,664.660	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,703,437.520	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,772,657.200	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,720,351.570	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,110,225.760	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,645,564.850	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,461,820.320	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,695,549.220	

US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,206,860.560	
US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,868,500.000	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,050,000.000	4,098,883.800	
US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,663,511.700	
US T N/B 0.625 08/15/30	7,740,000.000	6,230,548.800	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,424,915.990	
US T N/B 0.625 12/31/27	4,820,000.000	4,222,677.730	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,846,786.330	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,300,496.110	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,544,140.620	
US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,189,276.560	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,530,410.170	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,510,000.000	4,163,734.180	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,010,000.000	3,677,216.990	
US T N/B 0.875 11/15/30	9,480,000.000	7,730,643.730	
US T N/B 1.0 07/31/28	4,770,000.000	4,177,569.720	
US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,704,094.000	
US T N/B 1.125 02/15/31	9,690,000.000	8,017,339.400	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,862,662.500	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,005,082.030	
US T N/B 1.125 02/29/28	4,690,000.000	4,176,206.830	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,080,160.140	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,060,000.000	1,909,332.400	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,278,247.460	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,134,570.870	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,117,756.450	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,545,773.410	
US T N/B 1.25 05/15/50	8,380,000.000	4,361,200.790	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,682,497.660	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,294,001.740	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,960,000.000	7,347,899.950	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,393,780.090	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,335,474.620	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,583,054.680	
US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	724,168.010	
US T N/B 1.375 08/15/50	6,870,000.000	3,696,784.550	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,605,750.000	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,172,857.600	
US T N/B 1.375 11/15/31	9,190,000.000	7,561,287.890	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,802,346.870	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,060,308.570	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,740,000.000	5,314,208.560	
US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,392,349.590	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,830,000.000	4,178,421.690	
US T N/B 1.5 08/15/26	7,030,000.000	6,568,381.650	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,448,730.450	
US T N/B 1.625 02/15/26	6,090,000.000	5,763,495.110	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,871,311.310	
US T N/B 1.625 05/15/31	8,040,000.000	6,833,528.920	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,360,000.000	2,970,843.750	

US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,450,521.470	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,250,808.180	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,480,000.000	2,579,499.990	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,687,683.600	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	4,038,486.340	
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,865,625.000	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,310,000.000	3,612,044.550	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,850,000.000	2,526,591.800	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,932,256.710	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,972,231.830	
US T N/B 1.875 02/15/32	8,280,000.000	7,053,039.860	
US T N/B 1.875 02/15/41	3,700,000.000	2,603,441.380	
US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,549,507.000	
US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,375,138.480	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,607,500.000	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,725,931.250	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,500,000.000	2,360,742.200	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,370,000.000	3,285,558.970	
US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,980,075.000	
US T N/B 2.0 02/15/50	4,420,000.000	2,817,663.650	
US T N/B 2.0 08/15/25	3,550,000.000	3,414,725.580	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,673,917.170	
US T N/B 2.0 11/15/26	3,830,000.000	3,611,869.540	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,009,531.250	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,822,782.230	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,250,000.000	2,144,355.470	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,578,227.710	
US T N/B 2.25 02/15/52	5,000,000.000	3,357,519.530	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,160,781.240	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,297,043.740	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,984,689.060	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,270,000.000	1,573,305.080	
US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,807,275.770	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,925,799.960	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,062,878.720	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,712,294.510	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,693,515.630	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,976,151.560	
US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,195,175.390	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,570,000.000	3,290,117.550	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	3,846,281.990	
US T N/B 2.375 11/15/49	3,490,000.000	2,431,207.590	
US T N/B 2.5 01/31/25	500,000.000	488,423.420	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,810,000.000	1,340,283.770	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,296,006.430	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,196,993.730	
US T N/B 2.5 03/31/27	4,000,000.000	3,811,093.750	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,730,000.000	1,263,474.400	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,378,656.620	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,522,276.150	

US T N/B 2. 625 03/31/25	1, 790, 000. 000	1, 747, 347. 660	
US T N/B 2. 625 04/15/25	3, 000, 000. 000	2, 925, 527. 340	
US T N/B 2. 625 05/31/27	4, 910, 000. 000	4, 685, 118. 160	
US T N/B 2. 625 07/31/29	3, 070, 000. 000	2, 858, 038. 070	
US T N/B 2. 625 12/31/25	3, 000, 000. 000	2, 903, 789. 070	
US T N/B 2. 75 02/15/28	4, 540, 000. 000	4, 320, 359. 740	
US T N/B 2. 75 02/28/25	1, 960, 000. 000	1, 917, 660. 940	
US T N/B 2. 75 04/30/27	6, 000, 000. 000	5, 753, 203. 130	
US T N/B 2. 75 05/15/25	2, 200, 000. 000	2, 146, 546. 860	
US T N/B 2. 75 05/31/29	3, 300, 000. 000	3, 098, 841. 790	
US T N/B 2. 75 06/30/25	1, 040, 000. 000	1, 014, 020. 300	
US T N/B 2. 75 07/31/27	3, 820, 000. 000	3, 653, 695. 680	
US T N/B 2. 75 08/15/32	7, 840, 000. 000	7, 107, 450. 000	
US T N/B 2. 75 08/15/42	1, 240, 000. 000	985, 630. 460	
US T N/B 2. 75 08/15/47	2, 230, 000. 000	1, 692, 273. 810	
US T N/B 2. 75 08/31/25	1, 830, 000. 000	1, 779, 960. 930	
US T N/B 2. 75 11/15/42	1, 556, 000. 000	1, 233, 130. 000	
US T N/B 2. 75 11/15/47	2, 250, 000. 000	1, 706, 000. 970	
US T N/B 2. 875 04/30/25	2, 000, 000. 000	1, 955, 507. 820	
US T N/B 2. 875 04/30/29	3, 800, 000. 000	3, 594, 636. 700	
US T N/B 2. 875 05/15/28	4, 860, 000. 000	4, 638, 262. 500	
US T N/B 2. 875 05/15/32	8, 050, 000. 000	7, 388, 390. 620	
US T N/B 2. 875 05/15/43	2, 290, 000. 000	1, 843, 181. 620	
US T N/B 2. 875 05/15/49	4, 600, 000. 000	3, 556, 195. 320	
US T N/B 2. 875 05/15/52	4, 510, 000. 000	3, 483, 446. 470	
US T N/B 2. 875 05/31/25	1, 570, 000. 000	1, 533, 448. 430	
US T N/B 2. 875 06/15/25	2, 420, 000. 000	2, 363, 706. 630	
US T N/B 2. 875 07/31/25	2, 200, 000. 000	2, 146, 074. 210	
US T N/B 2. 875 08/15/28	5, 030, 000. 000	4, 790, 485. 520	
US T N/B 2. 875 08/15/45	1, 770, 000. 000	1, 395, 672. 640	
US T N/B 2. 875 11/15/46	1, 080, 000. 000	843, 623. 410	
US T N/B 2. 875 11/30/25	3, 360, 000. 000	3, 268, 715. 620	
US T N/B 3. 0 02/15/47	2, 360, 000. 000	1, 881, 823. 420	
US T N/B 3. 0 02/15/48	2, 650, 000. 000	2, 103, 696. 280	
US T N/B 3. 0 02/15/49	4, 610, 000. 000	3, 651, 264. 050	
US T N/B 3. 0 05/15/42	1, 080, 000. 000	896, 210. 150	
US T N/B 3. 0 05/15/45	1, 290, 000. 000	1, 041, 498. 630	
US T N/B 3. 0 05/15/47	1, 620, 000. 000	1, 290, 178. 120	
US T N/B 3. 0 07/15/25	3, 200, 000. 000	3, 129, 375. 000	
US T N/B 3. 0 08/15/48	3, 810, 000. 000	3, 021, 062. 100	
US T N/B 3. 0 08/15/52	3, 740, 000. 000	2, 967, 164. 060	
US T N/B 3. 0 09/30/25	1, 750, 000. 000	1, 708, 095. 690	
US T N/B 3. 0 10/31/25	2, 270, 000. 000	2, 214, 358. 380	
US T N/B 3. 0 11/15/44	1, 960, 000. 000	1, 588, 786. 690	
US T N/B 3. 0 11/15/45	460, 000. 000	370, 057. 410	
US T N/B 3. 125 02/15/42	360, 000. 000	305, 852. 340	
US T N/B 3. 125 02/15/43	1, 740, 000. 000	1, 458, 745. 310	
US T N/B 3. 125 05/15/48	2, 830, 000. 000	2, 297, 329. 860	
US T N/B 3. 125 08/15/25	3, 030, 000. 000	2, 966, 855. 280	
US T N/B 3. 125 08/15/44	2, 090, 000. 000	1, 733, 924. 410	

US T N/B 3. 125 08/31/27	2, 940, 000. 000	2, 846, 517. 160	
US T N/B 3. 125 08/31/29	3, 110, 000. 000	2, 969, 321. 070	
US T N/B 3. 125 11/15/28	5, 480, 000. 000	5, 266, 900. 760	
US T N/B 3. 125 11/15/41	1, 020, 000. 000	868, 932. 410	
US T N/B 3. 25 05/15/42	3, 760, 000. 000	3, 232, 939. 060	
US T N/B 3. 25 06/30/27	4, 200, 000. 000	4, 090, 160. 170	
US T N/B 3. 25 06/30/29	2, 300, 000. 000	2, 213, 660. 160	
US T N/B 3. 375 05/15/33	5, 900, 000. 000	5, 595, 781. 250	
US T N/B 3. 375 05/15/44	1, 430, 000. 000	1, 235, 916. 590	
US T N/B 3. 375 08/15/42	2, 920, 000. 000	2, 553, 003. 910	
US T N/B 3. 375 11/15/48	3, 950, 000. 000	3, 352, 408. 170	
US T N/B 3. 5 01/31/28	3, 380, 000. 000	3, 312, 400. 000	
US T N/B 3. 5 01/31/30	2, 500, 000. 000	2, 428, 613. 270	
US T N/B 3. 5 02/15/33	7, 900, 000. 000	7, 575, 359. 360	
US T N/B 3. 5 02/15/39	1, 000, 000. 000	928, 476. 550	
US T N/B 3. 5 04/30/28	3, 100, 000. 000	3, 036, 667. 960	
US T N/B 3. 5 04/30/30	3, 000, 000. 000	2, 911, 699. 230	
US T N/B 3. 5 09/15/25	3, 000, 000. 000	2, 952, 890. 640	
US T N/B 3. 625 02/15/44	1, 630, 000. 000	1, 465, 312. 680	
US T N/B 3. 625 02/15/53	3, 800, 000. 000	3, 409, 015. 630	
US T N/B 3. 625 03/31/28	3, 800, 000. 000	3, 741, 441. 380	
US T N/B 3. 625 03/31/30	3, 300, 000. 000	3, 225, 621. 100	
US T N/B 3. 625 05/15/26	3, 500, 000. 000	3, 452, 421. 870	
US T N/B 3. 625 05/15/53	3, 510, 000. 000	3, 152, 144. 540	
US T N/B 3. 625 05/31/28	2, 500, 000. 000	2, 461, 669. 920	
US T N/B 3. 625 08/15/43	1, 470, 000. 000	1, 325, 813. 650	
US T N/B 3. 75 04/15/26	6, 000, 000. 000	5, 934, 257. 820	
US T N/B 3. 75 05/31/30	3, 500, 000. 000	3, 444, 082. 040	
US T N/B 3. 75 06/30/30	5, 700, 000. 000	5, 608, 710. 960	
US T N/B 3. 75 08/15/41	1, 220, 000. 000	1, 138, 436. 310	
US T N/B 3. 75 11/15/43	1, 460, 000. 000	1, 338, 551. 950	
US T N/B 3. 875 01/15/26	4, 300, 000. 000	4, 262, 039. 080	
US T N/B 3. 875 02/15/43	3, 500, 000. 000	3, 275, 234. 370	
US T N/B 3. 875 03/31/25	1, 050, 000. 000	1, 040, 053. 700	
US T N/B 3. 875 05/15/43	800, 000. 000	748, 125. 000	
US T N/B 3. 875 08/15/33	8, 000, 000. 000	7, 893, 750. 000	
US T N/B 3. 875 08/15/40	1, 290, 000. 000	1, 233, 083. 770	
US T N/B 3. 875 09/30/29	2, 150, 000. 000	2, 132, 699. 200	
US T N/B 3. 875 11/30/27	3, 000, 000. 000	2, 980, 664. 070	
US T N/B 3. 875 11/30/29	2, 800, 000. 000	2, 776, 703. 120	
US T N/B 3. 875 12/31/27	4, 600, 000. 000	4, 572, 867. 170	
US T N/B 3. 875 12/31/29	2, 800, 000. 000	2, 776, 539. 050	
US T N/B 4. 0 02/15/26	4, 000, 000. 000	3, 974, 687. 520	
US T N/B 4. 0 02/28/30	3, 000, 000. 000	2, 994, 140. 640	
US T N/B 4. 0 02/29/28	3, 200, 000. 000	3, 196, 124. 990	
US T N/B 4. 0 06/30/28	2, 000, 000. 000	1, 999, 414. 060	
US T N/B 4. 0 07/31/30	2, 500, 000. 000	2, 495, 312. 500	
US T N/B 4. 0 10/31/29	2, 700, 000. 000	2, 695, 359. 370	
US T N/B 4. 0 11/15/42	3, 120, 000. 000	2, 977, 589. 050	
US T N/B 4. 0 11/15/52	4, 860, 000. 000	4, 662, 562. 500	

	US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,111,699.200	
	US T N/B 4.125 01/31/25	1,800,000.000	1,788,278.590	
	US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,689,259.740	
	US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,512,646.470	
	US T N/B 4.125 08/15/53	1,000,000.000	982,343.750	
	US T N/B 4.125 09/30/27	3,220,000.000	3,227,483.980	
	US T N/B 4.125 10/31/27	940,000.000	942,019.530	
	US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,644,234.320	
	US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	959,537.090	
	US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,987,187.510	
	US T N/B 4.25 11/15/40	1,300,000.000	1,299,314.440	
	US T N/B 4.25 12/31/24	4,500,000.000	4,475,073.150	
	US T N/B 4.375 02/15/38	200,000.000	206,371.090	
	US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,232,002.130	
	US T N/B 4.375 05/15/41	1,630,000.000	1,648,687.680	
	US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	4,016,953.120	
	US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	2,002,656.240	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,021,386.720	
	US T N/B 4.375 12/15/26	800,000.000	805,375.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	500,000.000	525,371.080	
	US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	625,992.170	
	US T N/B 4.5 07/15/26	1,600,000.000	1,610,843.740	
	US T N/B 4.5 08/15/39	1,480,000.000	1,535,760.140	
	US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,576,345.100	
	US T N/B 4.625 02/15/40	1,690,000.000	1,774,500.000	
	US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,654,318.160	
	US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,539,238.290	
	US T N/B 4.625 10/15/26	3,400,000.000	3,440,109.380	
	US T N/B 4.625 11/15/26	600,000.000	607,570.310	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,304,784.950	
	US T N/B 5.0 05/15/37	755,000.000	830,647.450	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,423,880.850	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,160,000.000	1,262,134.380	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,478,374.990	
	US T N/B 6.125 11/15/27	2,200,000.000	2,362,250.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	852,333.270	
	アメリカ・ドル 小計	879,620,000.000 (128,116,653,000)	786,712,353.830 (114,584,654,333)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,621,756.500	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,162,800.270	
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	1,800,000.000	1,721,257.200	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,735,569.020	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,930,000.000	1,756,110.860	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,390,000.000	1,118,961.120	

UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,880,000.000	1,608,340.000	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	583,891.140	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	1,008,113.000	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,650,000.000	1,143,945.000	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,190,000.000	494,756.780	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,350,000.000	688,650.920	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,100,000.000	1,607,602.080	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,430,000.000	1,226,906.240	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,470,000.000	2,003,733.160	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	2,110,000.000	1,390,473.120	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	283,779.640	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	1,011,120.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,530,000.000	772,038.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,750,000.000	1,095,325.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,900,000.000	1,796,678.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,300,000.000	753,608.960	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,210,000.000	638,396.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	940,874.100	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	686,181.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	399,791.410	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	830,000.000	500,988.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	620,898.840	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,427,706.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,072,734.520	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	823,493.990	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,640,000.000	1,396,132.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,100,000.000	2,012,115.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,550,000.000	1,363,225.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,480,000.000	1,256,964.000	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,482,193.800	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,500,000.000	1,435,644.000	

	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	871,060.000	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,607,940.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	846,540.000	
	UK TREASURY 4.0 10/22/63	820,000.000	769,816.000	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,190,000.000	2,206,950.600	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,300,000.000	1,333,163.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,820,000.000	1,889,979.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,063,447.120	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,310,000.000	1,335,417.130	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,067,860.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,253,760.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,317,000.000	1,286,917.330	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,112,000.000	1,087,674.540	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,350,000.000	1,392,050.070	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,262,160.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,465,000.000	1,499,134.500	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	200,000.000	212,335.920	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,495,000.000	1,593,931.620	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,380,000.000	1,467,492.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,485,000.000	1,494,411.930	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	880,000.000	971,242.090	
	イギリス・ポンド 小計	82,614,000.000 (15,338,941,380)	69,156,036.520 (12,840,201,301)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,430,000.000	1,335,425.520	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,812,394.710	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,403,649.820	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,200,000.000	966,176.400	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,420,000.000	1,713,316.440	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,936,410.000	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	960,000.000	674,698.560	

	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,660,000.000	1,573,520.640	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,204,964.520	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,589,042.440	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,410,000.000	1,581,516.630	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,300,068.600	
イスラエル・シュケル 小計		21,220,000.000 (825,742,348)	19,091,184.280 (742,902,890)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,366,321.300	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	2,615,000.000	2,399,325.270	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,970,000.000	1,571,960.730	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,373,149.000	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,709,793.680	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,010,000.000	1,690,302.260	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	2,520,000.000	1,437,352.040	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,530,960.040	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,780,000.000	1,672,789.020	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,660,000.000	1,529,672.010	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	767,375.760	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	566,605.020	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,379,360.480	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	900,000.000	858,960.970	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,318,733.470	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	857,483.160	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,670,000.000	1,520,069.210	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,100,000.000	1,089,839.120	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,400,000.000	1,362,001.900	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	720,206.030	
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,200,000.000	1,131,965.830		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	788,797.300		
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,800,000.000	1,742,983.480		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,615,915.350		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,710,481.080		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,140,000.000	1,175,162.380		
オーストラリア・ドル 小計		39,315,000.000 (3,841,075,500)	34,887,565.890 (3,408,515,187)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	35,000,000.000	34,882,168.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	19,976,339.790	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,489,488.560	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	40,500,000.000	40,548,316.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND	31,800,000.000	31,813,117.500	

2.28 11/25/25			
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.3 05/15/26	39,500,000.000	39,508,180.450	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.39 11/15/26	7,000,000.000	7,016,231.600	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.4 07/15/28	25,000,000.000	24,987,128.750	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,026,590.200	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,191,256.070	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,484,212.800	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.6 09/01/32	14,300,000.000	14,304,328.610	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.62 06/25/30	7,000,000.000	7,050,022.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.62 09/25/29	15,500,000.000	15,594,923.550	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.67 05/25/33	7,000,000.000	7,053,967.200	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.68 05/21/30	64,600,000.000	65,120,495.120	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.69 08/12/26	55,600,000.000	56,124,018.880	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.69 08/15/32	21,000,000.000	21,213,124.800	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.75 02/17/32	15,500,000.000	15,676,479.900	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,295,328.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,138,926.700	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.79 12/15/29	24,000,000.000	24,358,454.400	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,198,924.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,149,602.000	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.8 11/15/32	31,300,000.000	31,825,148.270	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.85 06/04/27	23,500,000.000	23,852,025.300	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.88 02/25/33	11,200,000.000	11,504,246.880	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.89 11/18/31	15,100,000.000	15,429,003.330	
CHINA GOVERNMENT BOND			
2.91 10/14/28	28,100,000.000	28,722,035.650	
CHINA GOVERNMENT BOND			
3.01 05/13/28	49,000,000.000	50,277,679.900	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	16,500,000.000	17,014,903.950	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	45,000,000.000	45,757,138.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	9,500,000.000	10,020,446.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,276,351.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	5,500,000.000	5,920,590.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,896,713.240	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,176,989.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	15,820,000.000	17,096,110.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	16,100,000.000	17,719,439.430	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	12,450,000.000	14,058,674.460	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,234,995.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,600,000.000	8,876,059.760	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	14,500,000.000	17,141,072.050	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	5,800,000.000	6,878,419.520	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	10,300,000.000	12,500,838.080	
	オフショア・人民元 小計	917,520,000.000 (18,604,277,784)	939,380,507.100 (19,047,536,728)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,308,760.870	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,179,738.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,160,004.790	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	507,255.690	
	CANADA 1.0 09/01/26	2,070,000.000	1,934,278.740	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	675,826.430	
	CANADA 1.25 03/01/27	910,000.000	848,080.300	
	CANADA 1.25 06/01/30	2,350,000.000	2,077,437.120	
	CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,062,381.210	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,615,007.000	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,182,809.870	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,420,000.000	2,122,341.080	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,581,033.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	930,000.000	880,197.190	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,590,000.000	1,442,288.590	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,694,796.840	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,285,051.500	
	CANADA 2.25 06/01/29	530,000.000	504,201.500	

	CANADA 2.25 12/01/29	700,000.000	663,717.670	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,429,882.570	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,180,000.000	1,130,734.120	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,023,705.670	
	CANADA 2.75 12/01/48	960,000.000	884,586.760	
	CANADA 2.75 12/01/55	200,000.000	182,426.130	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	355,948.160	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,400,000.000	1,375,937.580	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,630,010.220	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,200,000.000	1,194,405.670	
	CANADA 3.25 12/01/33	2,100,000.000	2,096,318.700	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,130,000.000	1,133,608.750	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	395,837.680	
	CANADA 3.5 12/01/45	800,000.000	832,851.680	
	CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,149,941.370	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	625,881.970	
	CANADA 5.0 06/01/37	530,000.000	626,960.740	
	CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	829,994.520	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	730,790.790	
	カナダ・ドル 小計	48,900,000.000 (5,324,721,000)	45,355,030.470 (4,938,709,268)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	280,000.000	266,547.400	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	487,203.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	840,000.000	773,220.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	840,000.000	689,640.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	419,026.200	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	590,000.000	577,020.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	890,000.000	835,443.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	768,768.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	178,315.950	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	339,082.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	460,000.000	449,420.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	648,809.700	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	593,717.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	201,000.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	623,100.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	131,250.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	580,000.000	605,989.800	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	815,600.000	
	シンガポール・ドル 小計	9,805,000.000 (1,073,157,250)	9,403,152.050 (1,029,174,992)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,242,210.960	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,184,153.860	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,960,000.000	3,658,249.090	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	8,210,000.000	7,889,312.290	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,600,000.000	2,488,764.000	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	4,064,491.300	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,877,815.840	

	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,990,000.000	4,532,121.300	
スウェーデン・クローナ 小計		37,040,000.000 (527,449,600)	35,937,118.640 (511,744,569)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,251,706.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,560,000.000	2,478,323.520	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,533,475.900	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,240,000.000	4,739,910.620	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,740,000.000	3,679,005.820	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,700,000.000	1,677,495.400	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,650,000.000	9,606,135.600	
デンマーク・クローネ 小計		32,820,000.000 (703,332,600)	30,966,052.860 (663,602,513)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	544,605.000	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	527,746.140	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	713,856.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	251,533.450	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	748,815.900	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	720,000.000	699,816.930	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	643,353.460	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	540,000.000	363,603.730	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	701,781.410	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	412,217.280	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	125,323.120	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	800,648.160	
	ニュージーランド・ドル 小計		7,620,000.000 (692,124,600)	6,533,300.580 (593,419,692)
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,520,760.250	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,510,000.000	3,975,903.250	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,426,321.330	
	NORWAY 1.75 02/17/27	5,100,000.000	4,848,723.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,102,434.550	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,677,727.600	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,962,815.400	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,030,000.000	1,836,374.540	
	NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,793,251.000	
NORWAY 3.5 10/06/42	2,200,000.000	2,257,890.800		
ノルウェー・クローネ 小計		32,520,000.000 (457,556,400)	30,402,201.720 (427,758,978)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,660,989.400	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,170,000.000	3,960,707.700	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,720,000.000	3,750,658.320	

	POLAND 1.75 04/25/32	5,170,000.000	4,037,532.180	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,290,000.000	3,109,043.420	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,187,436.800	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,189,718.640	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,792,158.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,552,830.570	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,529,017.100	
	POLAND 5.75 04/25/29	2,190,000.000	2,271,157.020	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,752,577.960	
	ポーランド・ズロチ 小計	37,880,000.000 (1,397,150,768)	34,793,827.110 (1,283,321,602)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	1,018,359.460	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	648,184.740	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,373,115.150	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,006,728.000	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,435,905.200	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,804,134.510	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,653,365.310	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	706,386.030	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,009,529.700	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,748,719.630	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,678,266.460	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,920,000.000	1,941,561.400	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,950,000.000	1,965,756.000	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,635,414.670	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	686,763.120	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,400,000.000	1,426,943.140	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,069,930.570	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	2,000,000.000	2,055,213.800	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,248,246.600	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,059,234.960	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	1,013,406.700	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	960,000.000	1,033,008.650	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	320,018.580	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,826,021.000	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,185,173.230	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,755,557.440	
	マレーシア・リンギット 小計	37,560,000.000 (1,178,591,484)	38,304,944.050 (1,201,967,009)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,080,000.000	22,467,416.400	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	3,680,000.000	3,491,032.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,290,000.000	17,336,115.900	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	13,290,000.000	11,694,668.400	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	8,000,000.000	7,511,200.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,871,692.500	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	36,282,000.000	33,469,075.030	
	MEXICAN BONDS 7.5	28,146,000.000	26,617,953.660	

	06/03/27			
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,148,000.000	27,939,960.480	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	24,707,000.000	21,524,738.400	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	9,335,000.000	8,451,442.250	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,561,000.000	17,334,175.760	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	24,159,000.000	23,546,086.170	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,795,142.120	
	メキシコ・ペソ 小計	262,805,000.000 (2,254,525,254)	242,050,699.070 (2,076,480,332)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,180,000.000	1,010,664.100	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,410,000.000	1,170,261.930	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	620,000.000	550,220.410	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	510,000.000	309,519.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	280,000.000	199,696.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,373,981.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,170,000.000	1,096,719.390	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	185,583.220	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	935,000.000	870,930.990	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	345,341.160	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,132,091.030	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	134,022.660	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	600,000.000	521,333.400	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	915,770.560	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	550,857.840	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	112,214.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	590,000.000	466,250.450	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	453,393.810	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	289,129.230	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	870,000.000	837,859.590	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,100,000.000	1,111,584.100	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	557,569.420	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	300,000.000	303,493.800	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	358,728.280	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,136,539.870	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,210,000.000	1,264,499.610	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	690,462.960	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,080,000.000	985,210.010	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	848,698.240	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	1,300,000.000	1,113,450.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	864,675.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	930,000.000	604,890.600	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	369,593.400	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,380,000.000	1,338,544.800	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	1,260,000.000	1,190,989.800	

BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	873,730.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,200,000.000	1,105,198.800	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,360,000.000	1,309,224.400	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,570,000.000	1,399,075.670	
BELGIUM 1.25 04/22/33	410,000.000	361,912.740	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,390,000.000	900,642.160	
BELGIUM 1.45 06/22/37	780,000.000	645,279.180	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	672,768.400	
BELGIUM 1.7 06/22/50	880,000.000	636,655.360	
BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	527,216.900	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	340,425.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	309,209.100	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	306,419.840	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,221,897.600	
BELGIUM 3.0 06/22/34	480,000.000	486,845.280	
BELGIUM 3.3 06/22/54	270,000.000	267,653.700	
BELGIUM 3.45 06/22/43	100,000.000	103,134.400	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	691,542.400	
BELGIUM 4.0 03/28/32	930,000.000	1,020,772.650	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,464,151.040	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,111,596.250	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,570,000.000	1,881,305.880	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,793,225.600	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,510,000.000	3,325,023.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,532,605.770	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,610,000.000	1,497,206.620	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,760,000.000	2,589,956.400	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,650,000.000	2,530,299.500	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,292,301.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,280,000.000	2,207,724.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,300,000.000	1,262,157.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,100,000.000	2,101,848.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,720,000.000	1,515,130.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,340,000.000	2,019,092.400	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,500,000.000	2,108,362.500	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,360,000.000	1,049,090.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,880,000.000	1,409,097.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	3,730,000.000	3,252,075.100	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	777,201.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,790,000.000	1,527,514.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	683,422.080	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,678,863.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,010,000.000	541,733.700	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,540,000.000	1,290,878.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,490,788.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,560,000.000	2,313,699.840	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,994,199.200	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,430,000.000	1,303,394.950	

DEUTSCHLAND 0. 25 08/15/28	2, 570, 000. 000	2, 361, 624. 400	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/25	1, 900, 000. 000	1, 847, 066. 000	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/26	3, 860, 000. 000	3, 702, 589. 200	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/28	2, 120, 000. 000	1, 984, 044. 400	
DEUTSCHLAND 0. 5 08/15/27	2, 610, 000. 000	2, 459, 653. 560	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2, 590, 000. 000	2, 439, 049. 620	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2, 290, 000. 000	2, 038, 278. 620	
DEUTSCHLAND 1. 0 05/15/38	1, 660, 000. 000	1, 376, 306. 000	
DEUTSCHLAND 1. 0 08/15/25	2, 420, 000. 000	2, 353, 764. 600	
DEUTSCHLAND 1. 25 08/15/48	2, 820, 000. 000	2, 219, 813. 760	
DEUTSCHLAND 1. 7 08/15/32	2, 330, 000. 000	2, 248, 217. 000	
DEUTSCHLAND 1. 8 08/15/53	1, 850, 000. 000	1, 609, 037. 500	
DEUTSCHLAND 2. 1 11/15/29	2, 000, 000. 000	1, 995, 760. 000	
DEUTSCHLAND 2. 3 02/15/33	3, 050, 000. 000	3, 081, 201. 500	
DEUTSCHLAND 2. 3 02/15/33	700, 000. 000	707, 035. 000	
DEUTSCHLAND 2. 4 11/15/30	300, 000. 000	304, 767. 000	
DEUTSCHLAND 2. 5 07/04/44	2, 170, 000. 000	2, 183, 410. 600	
DEUTSCHLAND 2. 5 08/15/46	2, 240, 000. 000	2, 264, 505. 600	
DEUTSCHLAND 3. 25 07/04/42	1, 330, 000. 000	1, 482, 817. 000	
DEUTSCHLAND 4. 0 01/04/37	2, 030, 000. 000	2, 393, 976. 970	
DEUTSCHLAND 4. 25 07/04/39	1, 130, 000. 000	1, 391, 640. 200	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/28	1, 180, 000. 000	1, 311, 570. 000	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/34	2, 020, 000. 000	2, 484, 377. 800	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/40	1, 610, 000. 000	2, 108, 858. 500	
DEUTSCHLAND 5. 5 01/04/31	2, 620, 000. 000	3, 184, 452. 800	
DEUTSCHLAND 5. 625 01/04/28	1, 310, 000. 000	1, 477, 313. 200	
DEUTSCHLAND 6. 25 01/04/30	1, 180, 000. 000	1, 450, 137. 400	
DEUTSCHLAND 6. 5 07/04/27	650, 000. 000	740, 057. 500	
FINLAND 0. 0 09/15/30	510, 000. 000	430, 236. 000	
FINLAND 0. 125 04/15/36	280, 000. 000	200, 207. 680	
FINLAND 0. 125 04/15/52	440, 000. 000	207, 508. 220	
FINLAND 0. 125 09/15/31	500, 000. 000	413, 438. 000	
FINLAND 0. 25 09/15/40	290, 000. 000	187, 103. 360	
FINLAND 0. 5 04/15/26	460, 000. 000	438, 714. 880	
FINLAND 0. 5 04/15/43	380, 000. 000	241, 891. 280	
FINLAND 0. 5 09/15/27	400, 000. 000	372, 169. 200	
FINLAND 0. 5 09/15/28	650, 000. 000	592, 986. 550	
FINLAND 0. 5 09/15/29	800, 000. 000	715, 590. 550	
FINLAND 0. 75 04/15/31	600, 000. 000	527, 084. 280	
FINLAND 0. 875 09/15/25	810, 000. 000	785, 196. 180	
FINLAND 1. 125 04/15/34	480, 000. 000	409, 328. 430	

FINLAND 1. 375 04/15/27	210,000.000	202,463.600	
FINLAND 1. 375 04/15/47	380,000.000	279,839.980	
FINLAND 1. 5 09/15/32	550,000.000	499,725.320	
FINLAND 2. 625 07/04/42	330,000.000	312,844.950	
FINLAND 2. 75 04/15/38	270,000.000	262,913.310	
FINLAND 2. 75 07/04/28	390,000.000	394,233.450	
FINLAND 4. 0 07/04/25	320,000.000	325,106.880	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/25	1,190,000.000	1,149,290.690	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/26	3,530,000.000	3,339,676.520	
FRANCE OAT 0. 0 02/25/27	3,500,000.000	3,238,956.000	
FRANCE OAT 0. 0 05/25/32	2,790,000.000	2,246,508.000	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/29	3,590,000.000	3,109,923.660	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/30	4,780,000.000	4,026,748.480	
FRANCE OAT 0. 0 11/25/31	3,670,000.000	3,003,494.970	
FRANCE OAT 0. 25 11/25/26	3,220,000.000	3,018,170.400	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/25	3,430,000.000	3,317,118.700	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/26	4,960,000.000	4,722,242.400	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/29	3,490,000.000	3,149,184.050	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/40	1,950,000.000	1,310,749.050	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/72	790,000.000	311,730.050	
FRANCE OAT 0. 5 06/25/44	1,390,000.000	842,662.480	
FRANCE OAT 0. 75 02/25/28	3,780,000.000	3,528,317.200	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/28	4,690,000.000	4,360,944.910	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/52	3,470,000.000	1,913,489.860	
FRANCE OAT 0. 75 05/25/53	2,850,000.000	1,537,677.600	
FRANCE OAT 0. 75 11/25/28	4,600,000.000	4,242,432.800	
FRANCE OAT 03/25/25	2,070,000.000	1,995,614.550	
FRANCE OAT 1. 0 05/25/27	3,560,000.000	3,389,116.440	
FRANCE OAT 1. 0 11/25/25	2,740,000.000	2,653,603.590	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/34	3,560,000.000	3,075,644.200	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/36	2,980,000.000	2,466,844.000	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/38	900,000.000	714,510.000	
FRANCE OAT 1. 5 05/25/31	5,780,000.000	5,380,434.380	
FRANCE OAT 1. 5 05/25/50	3,470,000.000	2,435,881.010	
FRANCE OAT 1. 75 05/25/66	940,000.000	644,503.480	
FRANCE OAT 1. 75 06/25/39	2,450,000.000	2,076,201.050	
FRANCE OAT 2. 0 05/25/48	1,950,000.000	1,563,151.200	
FRANCE OAT 2. 0 11/25/32	3,350,000.000	3,178,845.150	
FRANCE OAT 2. 5 05/25/30	4,650,000.000	4,649,897.290	
FRANCE OAT 2. 5 05/25/43	1,200,000.000	1,086,672.800	
FRANCE OAT 2. 5 09/24/26	3,620,000.000	3,611,068.540	
FRANCE OAT 2. 75 02/25/29	1,900,000.000	1,922,959.030	
FRANCE OAT 2. 75 10/25/27	2,790,000.000	2,816,055.810	
FRANCE OAT 3. 0 05/25/33	3,000,000.000	3,074,654.700	
FRANCE OAT 3. 25 05/25/45	2,540,000.000	2,578,976.300	
FRANCE OAT 3. 5 04/25/26	3,850,000.000	3,923,142.300	
FRANCE OAT 4. 0 04/25/55	1,530,000.000	1,752,985.260	
FRANCE OAT 4. 0 04/25/60	1,460,000.000	1,690,569.040	
FRANCE OAT 4. 0 10/25/38	2,040,000.000	2,285,673.120	
FRANCE OAT 4. 5 04/25/41	2,540,000.000	3,023,410.260	

FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,756,115.060	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,100,000.000	3,553,353.300	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,610,000.000	3,234,270.240	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,289,228.480	
IRISH 0.0 10/18/31	670,000.000	554,453.470	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	390,625.400	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	301,897.860	
IRISH 0.35 10/18/32	600,000.000	498,421.200	
IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	288,185.600	
IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	170,579.000	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	667,932.700	
IRISH 1.0 05/15/26	1,000,000.000	965,128.000	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	682,781.410	
IRISH 1.3 05/15/33	190,000.000	170,131.700	
IRISH 1.35 03/18/31	660,000.000	612,951.900	
IRISH 1.5 05/15/50	570,000.000	417,120.300	
IRISH 1.7 05/15/37	680,000.000	595,442.000	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	707,879.760	
IRISH 2.4 05/15/30	860,000.000	859,160.640	
IRISH 3.0 10/18/43	210,000.000	212,550.030	
IRISH 5.4 03/13/25	590,000.000	605,067.420	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,889,912.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,850,000.000	1,714,765.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,298,086.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,800,000.000	1,566,990.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,528,936.500	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	979,330.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,920,000.000	1,552,682.880	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,604,493.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,766,225.210	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,480,000.000	1,024,012.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,080,000.000	874,908.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,156,410.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,559,040.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,399,567.500	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,035,210.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,318,234.400	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,630,000.000	1,552,685.840	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,642,632.020	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	776,424.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,880,000.000	1,836,970.560	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,110,000.000	688,533.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,560,000.000	1,523,613.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,850,000.000	2,759,085.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,990,000.000	1,722,774.840	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,140,000.000	1,904,728.400	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,120,000.000	674,758.560	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	817,880.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,216,192.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,540,000.000	1,477,140.280	

ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,628,143.330	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,644,389.600	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,790,000.000	1,751,396.750	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	216,540.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	334,458.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,547,706.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,127,848.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,195,034.260	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,200,000.000	863,280.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,534,932.450	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,224,492.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,720,000.000	1,694,372.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,070,000.000	831,604.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	400,000.000	287,000.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,171,800.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,907,994.650	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,325,440.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,210,000.000	2,180,488.220	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,060,000.000	928,618.300	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	545,940.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,182,582.720	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	2,120,000.000	2,015,528.520	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,162,420.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,048,750.570	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,321,135.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,189,421.500	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	600,000.000	609,600.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,525,350.450	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,230,000.000	1,147,639.200	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	800,000.000	816,960.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,745,050.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,470,000.000	1,473,087.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,172,412.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,100,000.000	1,134,540.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,600,000.000	1,687,680.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	800,000.000	815,760.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,173,722.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	670,000.000	681,122.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,180,000.000	2,326,908.020	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,560,000.000	1,656,833.880	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	360,000.000	366,464.160	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,360,000.000	2,598,360.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,890,000.000	2,066,337.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,650,000.000	1,804,440.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,913,768.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,660,000.000	3,076,822.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,260,000.000	2,631,092.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,257,230.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,250,000.000	1,392,250.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	2,180,000.000	2,069,262.750	

NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,098,658.100	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,310,000.000	1,165,679.920	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	650,000.000	448,361.740	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,430,000.000	702,380.250	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	600,699.260	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,591,083.100	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,360,000.000	1,214,021.680	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,210,000.000	872,327.910	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,820,000.000	1,733,095.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	800,000.000	681,230.480	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,460,000.000	1,381,341.760	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,379,565.720	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	572,939.400	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	910,000.000	912,088.450	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	350,000.000	349,580.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,810,000.000	1,839,977.220	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,320,000.000	1,519,101.770	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,320,000.000	1,518,000.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	940,000.000	1,054,492.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,330,000.000	1,285,671.100	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,547,313.760	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,810,000.000	1,665,290.500	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,680,000.000	1,507,128.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	833,611.380	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,880,000.000	1,531,260.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,558,818.000	
SPAIN 0.5 10/31/31	2,140,000.000	1,775,677.840	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,630,000.000	1,438,519.010	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,538,820.750	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,550,000.000	1,449,715.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,523,625.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,100,000.000	793,087.900	
SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	350,298.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,790,000.000	969,635.840	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,810,000.000	1,264,194.500	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,450,000.000	2,204,265.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,130,000.000	2,047,710.870	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,053,390.710	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,670,000.000	1,575,561.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,500,000.000	1,403,251.500	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,774,724.580	
SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	197,808.460	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,510,000.000	1,451,034.500	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,598,166.100	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,390,000.000	1,198,499.700	

	SPAIN 1.9 10/31/52	1,270,000.000	850,013.540	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,730,000.000	1,696,062.590	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,673,596.950	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,786,647.730	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,070,000.000	1,000,450.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,652,416.040	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,610,000.000	1,343,715.660	
	SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,797,660.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,230,000.000	1,078,830.540	
	SPAIN 3.15 04/30/33	1,570,000.000	1,573,403.760	
	SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	713,818.760	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,012,393.760	
	SPAIN 3.5 05/31/29	500,000.000	516,932.500	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,820,000.000	1,875,692.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,660,000.000	1,802,301.840	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,940,305.660	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,880,000.000	2,145,824.480	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,210,825.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,060,000.000	2,276,712.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,465,896.850	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,965,000.000	2,365,598.650	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,330,000.000	2,503,161.160	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,255,728.720	
	ユーロ 小計	530,550,000.000 (84,787,195,500)	494,457,151.660 (79,019,197,407)	
国債証券 合計		265,122,494,467.500 (265,122,494,468)	242,369,186,801 (242,369,186,801)	
合計			242,369,186,801 (242,369,186,801)	

(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 254銘柄	46.53	47.28
イギリス・ポンド	国債証券 58銘柄	5.21	5.30
イスラエル・シケル	国債証券 12銘柄	0.30	0.31
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	1.38	1.41
オフショア・人民元	国債証券 45銘柄	7.74	7.86
カナダ・ドル	国債証券 37銘柄	2.01	2.04
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.42	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.27	0.27
ニュージーランド・ドル	国債証券 12銘柄	0.24	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.17	0.18
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.52	0.53
マレーシア・リンギット	国債証券 26銘柄	0.49	0.50

メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.84	0.86
ユーロ	国債証券	342銘柄	32.09	32.60

(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)

2024年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,869,463,623
コール・ローン	895,206,886
株式	1,209,456,597,946
投資信託受益証券	2,007,720,202
投資証券	23,510,599,732
派生商品評価勘定	447,947,257
未収配当金	1,116,644,735
差入委託証拠金	8,680,890,196
流動資産合計	1,259,985,070,577
資産合計	1,259,985,070,577
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,455,016
未払解約金	1,269,497,000
流動負債合計	1,322,952,016
負債合計	1,322,952,016
純資産の部	
元本等	
元本	160,807,419,421
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	1,097,854,699,140
元本等合計	1,258,662,118,561
純資産合計	1,258,662,118,561
負債純資産合計	1,259,985,070,577

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7月12日 至 2024年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	150,991,460,168円
同期中追加設定元本額	42,536,307,367円
同期中一部解約元本額	32,720,348,114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, 128, 184, 039円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	1, 531, 018円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6, 233, 160円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	15, 948, 412円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21, 267, 245円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	19, 283, 292円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	13, 642, 057円
たわらノーロード 先進国株式	55, 926, 978, 994円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	271, 640, 854円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2, 950, 183, 240円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	916, 608, 595円
たわらノーロード バランス (堅実型)	86, 800, 206円
たわらノーロード バランス (標準型)	784, 148, 191円
たわらノーロード バランス (積極型)	1, 033, 260, 998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, 501, 301円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	208, 866, 486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)	242, 192, 200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)	418, 060, 592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)	129, 995円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	13, 954, 908円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2, 992, 588円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	10, 517, 745円
たわらノーロード 全世界株式	1, 459, 470, 314円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	56, 556, 941, 029円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3, 246, 655, 594円
O n e グローバルバランス	20, 936, 990円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	135, 570, 417円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	748, 278, 630円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1, 010, 800, 940円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	81, 866, 001円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	228, 321, 872円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	237, 223, 346円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17, 324, 819円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	661, 374, 253円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	120, 402, 683円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	159, 091, 288円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	185, 469, 092円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	310, 857, 088円
投資のソムリエ	10, 002, 508, 196円
クルーズコントロール	99, 618, 178円
投資のソムリエ<DC年金>	962, 405, 473円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	180, 537, 951円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	283, 766, 424円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1, 083, 058, 915円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3, 606, 972, 573円
ワールドアセットバランス (基本コース)	111, 623, 980円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	234, 010, 049円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	58, 151, 930円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	29,354,634円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	9,259,264円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	191,917,200円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	138,504,634円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	989,801,396円
９資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	133,792,920円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	65,268,596円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	31,844,529円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	19,420,783円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	136,030,164円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,592,602円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	28,201,646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）	209,356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）	228,308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）	92,290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）	236,047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）	446,629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）	192,676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）	340,931,490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）	34,996,421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）	1,105,981,067円
DIAM先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,645,900円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,234,342,586円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	312,798,526円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	768,989円
DIAMワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	5,524,946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）	351,579円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	4,253,427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）	19,656,355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）	37,663,527円
DIAM国際分散バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	1,470,764円
DIAM国際分散バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	8,966,412円
DIAM国内重視バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	964,562円
DIAM国内重視バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	29,957円
DIAM世界バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	759,522円
DIAM世界バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	15,616,979円
DIAMバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	108,374,161円
DIAMバランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	198,222,031円
DIAMバランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	691,557,102円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	30,683,582円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA２（適格機関投資家限	25,068,627円

定)	
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	170,764,485円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	5,515,438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)	136,121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)	62,876,119円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,834,053円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	22,042,352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)	38,465,370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)	76,368,544円
動的パッケージファンド<DC年金>	14,184,867円
コア資産形成ファンド	7,538,079円
たわらノーロード 先進国株式 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	2,600,149,750円
MHAM外国株式インデックスファンド	133,704,647円
たわらノーロード 先進国株式 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	7,847,856円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,672,117,081円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,924,685,550円
計	160,807,419,421円
2. 受益権の総数	160,807,419,421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7月12日 至 2024年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年1月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	124,819,979,161	
投資信託受益証券	140,191,816	
投資証券	598,051,207	
合計	125,558,222,184	

(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2024年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年1月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売建	492,623,053	—	496,253,431	△3,630,378	
アメリカ・ドル	398,772,480	—	401,494,466	△2,721,986	
イギリス・ポンド	16,366,655	—	16,522,120	△155,465	
オーストラリア・ドル	3,484,008	—	3,516,775	△32,767	
カナダ・ドル	16,749,610	—	16,875,547	△125,937	
ユーロ	57,250,300	—	57,844,523	△594,223	
買建	757,878,179	—	757,902,343	24,164	
アメリカ・ドル	579,645,990	—	579,671,481	25,491	
イギリス・ポンド	37,660,966	—	37,662,407	1,441	
オーストラリア・ドル	15,917,113	—	15,915,466	△1,647	
カナダ・ドル	8,378,678	—	8,378,577	△101	
ユーロ	116,275,432	—	116,274,412	△1,020	
合計	1,250,501,232	—	1,254,155,774	△3,606,214	

(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	2024年1月11日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	24,052,741,600	—		24,450,840,055	398,098,455
合計	24,052,741,600	—		24,450,840,055	398,098,455

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年1月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	7.8271円 (78,271円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,396,226	153.730	214,641,822.980	
	ABBOTT LABORATORIES	261,414	114.400	29,905,761.600	
	AES CORP	109,122	18.880	2,060,223.360	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	136,698	161.230	22,039,818.540	
	ADVANCED MICRO DEVICES	242,950	148.540	36,087,793.000	

ADOBE INC	68,332	591.030	40,386,261.960	
CHUBB LTD	61,414	225.250	13,833,503.500	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	32,968	266.960	8,801,137.280	
ALLSTATE CORP	39,652	150.310	5,960,092.120	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	100,009	202.400	20,241,821.600	
AMGEN INC	80,312	304.570	24,460,625.840	
HESS CORP	41,496	138.920	5,764,624.320	
AMERICAN EXPRESS CO	93,688	184.970	17,329,469.360	
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,342	82.540	6,383,808.680	
AFLAC INC	84,730	82.640	7,002,087.200	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	67.590	7,309,858.500	
ANALOG DEVICES	74,327	188.370	14,000,976.990	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	102,432	57.440	5,883,694.080	
VALERO ENERGY CORP	54,042	124.770	6,742,820.340	
ANSYS INC	13,252	354.860	4,702,604.720	
APPLE INC	2,350,542	186.190	437,647,414.980	
APPLIED MATERIALS INC	124,811	149.810	18,697,935.910	
ALBEMARLE CORP	16,936	132.940	2,251,471.840	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	69.330	5,650,672.320	
AMEREN CORP	40,644	73.780	2,998,714.320	
AUTODESK INC	32,074	238.820	7,659,912.680	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	61,235	235.290	14,407,983.150	
AUTOZONE INC	2,716	2,537.160	6,890,926.560	
AVERY DENNISON CORP	11,542	196.080	2,263,155.360	
BALL CORP	46,288	57.300	2,652,302.400	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	197,086	367.920	72,511,881.120	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	116,387	52.730	6,137,086.510	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	40.290	2,874,167.730	
BECTON DICKINSON & CO	43,938	238.410	10,475,258.580	
AMETEK INC	34,476	163.680	5,643,031.680	
VERIZON COMM INC	635,060	39.080	24,818,144.800	
WR BERKLEY CORP	31,607	72.000	2,275,704.000	
BEST BUY CO INC	30,568	75.770	2,316,137.360	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	320.760	969,015.960	
YUM! BRANDS INC	42,053	129.200	5,433,247.600	
FIRSTENERGY CORP	83,697	38.740	3,242,421.780	
BOEING CO	86,601	227.840	19,731,171.840	
ROBERT HALF INC	14,456	80.800	1,168,044.800	
BORGWARNER INC	37,010	33.890	1,254,268.900	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	221,959	59.510	13,208,780.090	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	87.190	1,502,545.270	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	26,064	159.210	4,149,649.440
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,176.860	4,014,269.460
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	312,164	50.660	15,814,228.240
ONEOK INC	86,702	70.860	6,143,703.720
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	118.630	1,151,778.670
UNITED RENTALS INC	10,788	549.680	5,929,947.840
SEMPRA	93,163	76.130	7,092,499.190
FEDEX CORP	35,569	250.810	8,921,060.890
VERISIGN INC	13,302	203.420	2,705,892.840
AMPHENOL CORP	88,014	96.210	8,467,826.940
BROWN-FORMAN CORP	48,308	55.590	2,685,441.720
QUANTA SERVICES INC	23,271	203.640	4,738,906.440
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	5.370	546,478.050
CSX CORP	304,211	34.700	10,556,121.700
COTERRA ENERGY INC	114,711	25.370	2,910,218.070
CAMPBELL SOUP CO	26,978	43.720	1,179,478.160
CONSTELLATION BRANDS INC	24,629	254.770	6,274,730.330
CARDINAL HEALTH INC	38,298	104.190	3,990,268.620
CARLISLE COS INC	7,520	305.980	2,300,969.600
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	17.780	2,638,694.240
CATERPILLAR INC	76,504	293.350	22,442,448.400
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	155.220	1,960,583.820
JPMORGAN CHASE & CO	435,612	171.020	74,498,364.240
CHURCH & DWIGHT CO INC	35,778	96.480	3,451,861.440
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,876	107.420	2,457,339.920
CINTAS CORP	13,507	587.020	7,928,879.140
CISCO SYSTEMS INC	609,273	50.240	30,609,875.520
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	18.590	1,289,606.890
CLOROX COMPANY	18,305	141.370	2,587,777.850
COCA-COLA CO/THE	617,137	60.200	37,151,647.400
COPART INC	128,373	47.930	6,152,917.890
COLGATE-PALMOLIVE CO	117,230	80.550	9,442,876.500
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	38,376	226.770	8,702,525.520
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	379.660	3,389,604.480
NRG ENERGY, INC.	34,874	50.940	1,776,481.560
COMCAST CORP-CL A	616,451	43.480	26,803,289.480
CONAGRA BRANDS INC	73,639	29.230	2,152,467.970
CONSOLIDATED EDISON INC	51,736	94.320	4,879,739.520
CMS ENERGY CORP	44,128	59.500	2,625,616.000
COOPER COS INC	7,240	384.870	2,786,458.800
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	63.560	1,934,512.160
CORNING INC	116,325	30.690	3,570,014.250
HEICO CORP-CL A	11,614	135.190	1,570,096.660

MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	207.090	1,955,343.780
CUMMINS INC	21,250	239.220	5,083,425.000
DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	46.270	1,101,503.620
DR HORTON INC	45,784	154.520	7,074,543.680
DANAHER CORP	105,610	229.640	24,252,280.400
MOODY'S CORP	24,521	376.590	9,234,363.390
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	73.350	5,574,379.950
TARGET CORP	69,096	144.090	9,956,042.640
DEERE & CO	41,361	393.710	16,284,239.310
MORGAN STANLEY	185,673	91.480	16,985,366.040
REPUBLIC SERVICES INC	33,574	164.300	5,516,208.200
COSTAR GROUP INC	61,975	82.710	5,125,952.250
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	695.910	2,593,656.570
THE WALT DISNEY CO	275,728	89.290	24,619,753.120
DOLLAR TREE INC	31,756	137.620	4,370,260.720
DOVER CORP	20,350	147.170	2,994,909.500
OMNICOM GROUP	30,586	88.230	2,698,602.780
DTE ENERGY CO	30,044	110.830	3,329,776.520
DUKE ENERGY CORP	118,123	99.280	11,727,251.440
DARDEN RESTAURANTS INC	17,701	161.040	2,850,569.040
EBAY INC	75,181	42.560	3,199,703.360
BANK OF AMERICA CORP	1,077,648	33.600	36,208,972.800
CITIGROUP INC	288,199	53.020	15,280,310.980
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	87.750	1,473,322.500
EATON CORP PLC	59,302	240.890	14,285,258.780
CADENCE DESIGN SYS INC	40,689	263.260	10,711,786.140
ECOLAB INC	38,151	197.390	7,530,625.890
REVVITY INC	17,972	111.680	2,007,112.960
ELECTRONIC ARTS INC	38,801	137.630	5,340,181.630
SALESFORCE INC	146,338	264.130	38,652,255.940
ERIE INDEMNITY CO	3,372	328.300	1,107,027.600
EMERSON ELECTRIC CO	84,776	94.770	8,034,221.520
ATMOS ENERGY CORP	21,199	118.040	2,502,329.960
ENTERGY CORP	30,736	104.540	3,213,141.440
EOG RESOURCES INC	86,645	114.990	9,963,308.550
EQUIFAX INC	18,730	244.830	4,585,665.900
EQT CORP	59,729	37.710	2,252,380.590
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	135.670	4,863,226.820
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	125.080	2,803,668.200
EXXON MOBIL CORP	600,687	98.690	59,281,800.030
FMC CORP	17,711	59.510	1,053,981.610
NEXTERA ENERGY INC	309,921	62.280	19,301,879.880
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	462.770	2,504,511.240
FAIR ISAAC CORP	3,775	1,200.230	4,530,868.250
ASSURANT INC	8,766	163.300	1,431,487.800
FASTENAL CO	85,603	63.080	5,399,837.240
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	35.360	3,727,297.600

M&T BANK CORP	24,958	136.840	3,415,252.720
FISERV INC	91,718	135.400	12,418,617.200
FORD MOTOR CO	585,908	11.830	6,931,291.640
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	29.080	1,380,631.160
FREEMONT-MCMORAN INC	214,628	41.300	8,864,136.400
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,401.250	2,219,580.000
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,707	230.150	7,297,366.050
GENERAL DYNAMICS CORP	34,634	251.250	8,701,792.500
GENERAL MILLS INC	88,517	63.150	5,589,848.550
GENUINE PARTS CO	20,769	137.670	2,859,268.230
GILEAD SCIENCES INC	185,219	84.500	15,651,005.500
GARTNER INC	11,988	441.560	5,293,421.280
MCKESSON CORP	20,139	483.690	9,741,032.910
NVIDIA CORP	371,467	543.500	201,892,314.500
GRACO INC	23,985	83.300	1,997,950.500
GENERAL ELECTRIC CO	164,658	129.700	21,356,142.600
WW GRAINGER INC	6,777	830.830	5,630,534.910
HALLIBURTON CO	139,251	34.070	4,744,281.570
MONSTER BEVERAGE CORP	117,637	58.910	6,929,995.670
GOLDMAN SACHS GROUP INC	49,219	381.960	18,799,689.240
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,728	203.470	5,845,286.160
HASBRO INC	16,359	50.750	830,219.250
HENRY SCHEIN INC	17,431	74.730	1,302,618.630
HEICO CORP	6,878	171.360	1,178,614.080
HERSHEY FOODS CORP	22,500	189.640	4,266,900.000
HP INC	134,136	30.340	4,069,686.240
F5 INC	8,981	175.720	1,578,141.320
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	91.480	1,658,075.000
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	221.660	1,687,940.900
JUNIPER NETWORKS INC	57,881	37.590	2,175,746.790
HOLOGIC INC	38,399	71.830	2,758,200.170
HOME DEPOT INC	150,144	356.800	53,571,379.200
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	95.890	2,523,728.910
HORMEL FOODS CORP	49,054	31.890	1,564,332.060
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	29.250	2,859,948.000
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	444.070	2,183,492.190
HUBBELL INC	7,820	325.690	2,546,895.800
HUMANA INC	18,641	459.080	8,557,710.280
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	192.970	2,368,899.720
HUNTINGTON BANCSHARES INC	215,385	12.930	2,784,928.050
BIOGEN INC	21,910	254.230	5,570,179.300
IDEX CORP	11,045	209.620	2,315,252.900
ILLINOIS TOOL WORKS	44,869	253.980	11,395,828.620
INTUIT INC	42,167	608.700	25,667,052.900
IDEXX LABORATORIES INC	12,500	554.240	6,928,000.000

TRANE TECHNOLOGIES PLC	33,856	245.880	8,324,513.280	
INTEL CORP	629,190	47.470	29,867,649.300	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	80.540	3,301,576.220	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	37.560	1,658,386.680	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	32.580	1,761,372.540	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	167.610	1,987,351.770	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	129.520	2,536,778.720	
INCYTE CORP	31,654	64.140	2,030,287.560	
JOHNSON & JOHNSON	361,496	161.870	58,515,357.520	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	82.430	3,763,671.370	
KLA CORPORATION	20,432	556.090	11,362,030.880	
DEVON ENERGY CORP	96,985	43.940	4,261,520.900	
KELLANOVA	42,451	55.790	2,368,341.290	
KEYCORP	144,072	14.460	2,083,281.120	
KIMBERLY-CLARK CORP	50,460	123.270	6,220,204.200	
BLACKROCK INC/NEW YORK	22,139	792.360	17,542,058.040	
KROGER CO	103,385	46.140	4,770,183.900	
LAM RESEARCH CORP	20,026	749.690	15,013,291.940	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	440.830	2,892,285.630	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	165.950	2,232,193.450	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	66.300	1,343,238.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	116.080	2,706,173.040	
LENNAR CORP	37,667	153.350	5,776,234.450	
ELI LILLY & CO	121,042	630.190	76,279,457.980	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	44.130	1,242,524.280	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	110,884	161.220	17,876,718.480	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,825	131.090	5,876,109.250	
LOCKHEED MARTIN CORP	33,842	455.400	15,411,646.800	
LOEWS CORP	30,289	70.970	2,149,610.330	
LOWE' S COS INC	86,951	220.210	19,147,479.710	
DOMINION ENERGY INC	126,501	47.930	6,063,192.930	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	43.490	1,757,039.490	
MCCORMICK & CO INC	35,510	66.270	2,353,247.700	
MCDONALD' S CORPORATION	109,514	294.090	32,206,972.260	
S&P GLOBAL INC	48,610	433.130	21,054,449.300	
EVEREST GROUP LTD	6,670	370.500	2,471,235.000	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,410.000	2,838,330.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	91,510	76.120	6,965,741.200	
MARSH & MCLENNAN COS	74,055	192.440	14,251,144.200	
MASCO CORP	34,561	68.180	2,356,368.980	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,365	499.940	4,681,938.100	
METLIFE INC	97,405	69.300	6,750,166.500	
MEDTRONIC PLC	202,117	87.080	17,600,348.360	
CVS HEALTH CORP	197,356	79.240	15,638,489.440	
MERCK & CO. INC.	380,439	118.860	45,218,979.540	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	75.610	4,933,552.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,876	225.370	2,901,864.120	
MICROSOFT CORP	1,060,970	382.770	406,107,486.900	
MICRON TECH INC	163,017	82.380	13,429,340.460	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	81,668	85.440	6,977,713.920	
3M CO	82,577	108.300	8,943,089.100	
ENTEGRIS INC	20,987	112.940	2,370,271.780	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	213.140	1,635,636.360	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,847	315.040	7,827,798.880	
ILLUMINA INC	24,379	140.630	3,428,418.770	
XCEL ENERGY INC	82,777	62.720	5,191,773.440	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	132.390	1,934,615.070	
NETAPP INC	32,785	86.660	2,841,148.100	
NEWMONT CORP	173,608	37.950	6,588,423.600	
NVR INC	483	7,147.310	3,452,150.730	
NIKE INC-CL B	182,817	103.770	18,970,920.090	
NORDSON CORP	7,548	250.620	1,891,679.760	
NORFOLK SOUTHERN CORP	34,140	228.850	7,812,939.000	
EVERSOURCE ENERGY	51,861	58.360	3,026,607.960	
NISOURCE INC	64,543	27.340	1,764,605.620	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	84.150	2,765,842.200	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,526	471.950	10,159,195.700	
WELLS FARGO & CO	549,951	49.080	26,991,595.080	
NUCOR CORP	37,496	168.860	6,331,574.560	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	167.140	6,087,573.080	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,630	128.940	7,430,812.200	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,774	56.800	5,667,163.200	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,854	391.020	5,808,211.080	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	936.550	8,507,620.200	
ORACLE CORP	246,970	103.920	25,665,122.400	
PACCAR INC	77,744	94.600	7,354,582.400	
PTC INC	18,085	169.100	3,058,173.500	
EXELON CORP	147,025	36.640	5,386,996.000	
PARKER HANNIFIN CORP	19,211	460.780	8,852,044.580	
PAYCHEX INC	49,152	118.890	5,843,681.280	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,491	276.790	2,903,803.890	
PPL CORPORATION	113,687	27.610	3,138,898.070	

PEPSICO INC	206,840	166.920	34,525,732.800
PENTAIR PLC	25,545	70.740	1,807,053.300
PFIZER INC	849,236	28.990	24,619,351.640
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	38.660	1,558,732.540
CONOCOPHILLIPS	179,242	111.180	19,928,125.560
PG&E CORP	306,139	18.160	5,559,484.240
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34,773	221.020	7,685,528.460
ALTRIA GROUP INC	263,679	41.060	10,826,659.740
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	59,805	155.180	9,280,539.900
BROWN & BROWN INC	36,907	72.940	2,691,996.580
GARMIN LTD	23,281	123.250	2,869,383.250
PPG INDUSTRIES INC	35,748	147.290	5,265,322.920
COSTCO WHOLESALE CORP	66,410	672.760	44,677,991.600
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	107.390	3,682,725.270
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	137.100	2,272,295.400
PROCTER & GAMBLE CO	353,784	149.940	53,046,372.960
PROGRESSIVE CORP	87,083	165.510	14,413,107.330
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,243	62.010	4,603,808.430
PULTE GROUP INC	33,950	105.210	3,571,879.500
GLOBAL PAYMENTS INC	37,240	133.270	4,962,974.800
QUALCOMM INC	167,820	139.310	23,379,004.200
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,141	110.940	3,232,902.540
EXACT SCIENCES CORP	26,045	70.110	1,826,014.950
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	8,747	277.000	2,422,919.000
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,052	906.160	14,545,680.320
REPLIGEN CORP	8,576	178.160	1,527,900.160
RESMED INC	22,899	177.290	4,059,763.710
US BANCORP	229,227	43.400	9,948,451.800
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,309	76.960	4,333,540.640
ROSS STORES INC	50,878	135.960	6,917,372.880
ROLLINS INC	45,708	43.290	1,978,699.320
ROPER TECHNOLOGIES INC	15,771	530.300	8,363,361.300
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,327	302.070	5,233,966.890
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	34,772	123.600	4,297,819.200
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	107.060	2,061,761.480
ACCENTURE PLC-CL A	94,821	345.330	32,744,535.930
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	202,099	73.080	14,769,394.920
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	245.440	3,980,300.480
AXON ENTERPRISE INC	11,039	249.020	2,748,931.780
THE TRAVELERS COMPANIES INC	34,835	193.090	6,726,290.150
FIDELITY NATIONAL	89,354	62.450	5,580,157.300

INFORMATION				
BOOKING HOLDINGS INC	5,368	3,521.150	18,901,533.200	
SCHLUMBERGER LTD	212,211	48.450	10,281,622.950	
SCHWAB (CHARLES) CORP	224,033	65.820	14,745,852.060	
POOL CORP	5,406	389.850	2,107,529.100	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	123.230	3,957,408.220	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	62.900	910,603.300	
ELEVANCE HEALTH INC	35,171	480.240	16,890,521.040	
CENCORA INC	25,701	216.130	5,554,757.130	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	79.000	2,811,689.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	36,435	298.400	10,872,204.000	
CENTENE CORP	82,487	78.410	6,467,805.670	
SMITH (A. O.) CORP	19,563	80.480	1,574,430.240	
SNAP-ON INC	8,204	282.490	2,317,547.960	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,392	103.720	5,641,538.240	
EDISON INTERNATIONAL	57,612	72.330	4,167,075.960	
SOUTHERN CO	166,722	71.830	11,975,641.260	
TRUIST FINANCIAL CORP	198,729	37.730	7,498,045.170	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	29.710	585,287.000	
AT&T INC	1,063,626	16.870	17,943,370.620	
CHEVRON CORP	272,487	144.500	39,374,371.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	98.170	2,217,856.640	
STATE STREET CORP	50,416	76.600	3,861,865.600	
STARBUCKS CORP	170,073	93.500	15,901,825.500	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	112.840	2,588,211.080	
STRYKER CORP	51,849	307.780	15,958,085.220	
NETFLIX INC	66,811	478.330	31,957,705.630	
GEN DIGITAL INC	92,583	22.820	2,112,744.060	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	56.870	1,558,238.000	
SYNOPSYS INC	22,666	505.180	11,450,409.880	
SYSCO CORP	76,419	75.030	5,733,717.570	
INTUITIVE SURGICAL INC	53,463	364.450	19,484,590.350	
TELEFLEX INC	6,985	248.500	1,735,772.500	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	11.490	1,944,682.500	
TERADYNE INC	22,066	104.880	2,314,282.080	
TEXAS INSTRUMENTS INC	137,188	167.250	22,944,693.000	
TEXTRON INC	29,841	78.190	2,333,267.790	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	58,046	543.930	31,572,960.780	
GLOBE LIFE INC	12,153	120.500	1,464,436.500	
TORO CO	14,644	90.880	1,330,846.720	
DAVITA INC	6,813	109.640	746,977.320	
TRACTOR SUPPLY CO	16,808	220.030	3,698,264.240	
BIO-TECHNE CORP	25,934	73.150	1,897,072.100	

TRIMBLE INC	37,504	50.950	1,910,828.800
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,175	418.400	2,583,620.000
TYSON FOODS INC	41,316	54.500	2,251,722.000
MARATHON OIL CORP	92,952	22.850	2,123,953.200
UNION PACIFIC CORP	91,691	239.000	21,914,149.000
RTX CORP	217,454	86.080	18,718,440.320
UNITEDHEALTH GROUP INC	139,147	537.640	74,810,993.080
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	156.860	1,269,938.560
VF CORP	51,762	17.300	895,482.600
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	14.120	1,148,323.120
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	38,348	423.760	16,250,348.480
VULCAN MATERIALS CO	20,095	226.110	4,543,680.450
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	24.680	2,643,820.320
WALMART INC	222,066	161.290	35,817,025.140
WASTE MANAGEMENT INC	60,476	179.180	10,836,089.680
WATERS CORP	8,786	307.600	2,702,573.600
WATSCO INC	4,889	411.270	2,010,699.030
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,626	357.160	3,795,182.160
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	129.500	2,020,718.000
VAIL RESORTS INC	6,523	214.780	1,401,009.940
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	50.510	2,497,770.010
WABTEC CORP	25,714	126.240	3,246,135.360
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	104.330	2,319,777.550
WYNN RESORTS LTD	15,379	93.630	1,439,935.770
NASDAQ INC	52,969	56.890	3,013,406.410
CME GROUP INC	54,132	197.830	10,708,933.560
WILLIAMS COS INC	180,781	35.230	6,368,914.630
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	140.340	1,200,047.340
LKQ CORP	37,072	47.020	1,743,125.440
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	51.910	2,103,600.840
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	85.590	4,098,220.380
CARMAX INC	22,414	72.580	1,626,808.120
TJX COMPANIES INC	172,469	94.140	16,236,231.660
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	255.270	1,987,276.950
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.450	538,369.050
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	40.460	951,942.880
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	196.610	3,788,871.310
CBRE GROUP INC	44,502	86.650	3,856,098.300
REGIONS FINANCIAL CORP	133,681	18.920	2,529,244.520
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	414.130	2,127,385.810
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,127	589.190	4,199,157.130

WESTLAKE CORP	6,030	135.420	816,582.600
T-MOBILE US INC	80,697	163.290	13,177,013.130
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	49.290	2,357,047.800
MOSAIC CO/THE	48,502	33.670	1,633,062.340
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	272.000	1,666,272.000
CELANESE CORP	16,273	148.990	2,424,514.270
DEXCOM INC	58,553	128.000	7,494,784.000
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	167.300	3,271,384.200
EXPEDIA GROUP INC	21,978	151.850	3,337,359.300
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	78.080	2,418,059.520
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	377.990	5,872,452.640
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	84,672	127.650	10,808,380.800
LIVE NATION	23,597	89.500	2,111,931.500
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,117	2,245.000	9,242,665.000
TRANSDIGM GROUP INC	8,166	1,015.000	8,288,490.000
MASTERCARD INC	126,146	428.270	54,024,547.420
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	59.790	1,412,419.170
OWENS CORNING	13,227	150.780	1,994,367.060
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	109.710	1,981,472.310
AERCAP HOLDINGS NV	30,064	74.250	2,232,252.000
FIRST SOLAR INC	15,579	162.330	2,528,939.070
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,070	201.970	3,447,627.900
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,263	342.380	2,486,705.940
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	89.330	1,884,327.020
DELTA AIR LINES INC	21,592	42.110	909,239.120
INSULET CORP	10,158	205.070	2,083,101.060
DISCOVER FINANCIAL	39,188	111.030	4,351,043.640
TE CONNECTIVITY LTD	47,054	133.170	6,266,181.180
LULULEMON ATHLETICA INC	17,255	484.100	8,353,145.500
MERCADOLIBRE INC	6,748	1,598.160	10,784,383.680
ULTA BEAUTY INC	7,263	480.910	3,492,849.330
MSCI INC	11,948	546.660	6,531,493.680
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	233,121	94.470	22,022,940.870
VISA INC	241,677	264.560	63,938,067.120
KEURIG DR PEPPER INC	160,760	31.770	5,107,345.200
AMERICAN WATER WORKS CO INC	27,995	133.620	3,740,691.900
MARATHON PETROLEUM CORP	58,920	152.840	9,005,332.800
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	78.400	1,680,112.000
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	298,312	17.950	5,354,700.400
XYLEM INC	36,891	112.240	4,140,645.840
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,272	94.330	3,515,867.760

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	252.820	1,638,526.420
SPLUNK INC	22,702	152.490	3,461,827.980
EPAM SYSTEMS INC	8,162	299.640	2,445,661.680
HCA HEALTHCARE INC	30,702	282.500	8,673,315.000
VERISK ANALYTICS INC	21,663	233.960	5,068,275.480
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,706	120.250	1,287,396.500
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,295	280.260	2,885,276.700
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,938	211.290	8,227,210.020
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,242	127.220	2,447,967.240
TARGA RESOURCES CORP	33,263	83.810	2,787,772.030
LEAR CORP	9,398	134.760	1,266,474.480
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,608	175.610	2,740,920.880
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	60.670	2,080,677.650
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	134.060	4,483,502.640
FORTINET INC	100,599	61.370	6,173,760.630
HYATT HOTELS CORP	6,647	129.190	858,725.930
TESLA INC	429,981	233.940	100,589,755.140
ENPHASE ENERGY INC	18,600	117.540	2,186,244.000
GENERAL MOTORS CO	208,056	36.310	7,554,513.360
ALLY FINANCIAL INC	39,230	33.960	1,332,250.800
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	234.170	2,785,452.150
APTIV PLC	43,097	82.920	3,573,603.240
PHILLIPS 66	68,358	129.410	8,846,208.780
META PLATFORMS INC	334,116	370.470	123,779,954.520
IQVIA HOLDINGS INC	27,848	217.130	6,046,636.240
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,850	151.360	3,761,296.000
SERVICENOW INC	30,797	714.300	21,998,297.100
PALO ALTO NETWORKS INC	46,854	316.090	14,810,080.860
WORKDAY INC	31,060	276.810	8,597,718.600
ABBVIE INC	264,718	164.890	43,649,351.020
ZOETIS INC	68,687	198.770	13,652,914.990
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	24.190	1,311,364.090
CDW CORP	20,262	220.270	4,463,110.740
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	55.570	3,507,022.700
TWILIO INC	25,710	71.260	1,832,094.600
SNAP INC	152,250	17.370	2,644,582.500
TRADE DESK INC A	66,855	68.480	4,578,230.400
OKTA INC	21,831	83.950	1,832,712.450
BAKER HUGHES CO	152,160	31.230	4,751,956.800
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	107.180	2,334,916.300
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	11.820	1,914,390.840
BROADCOM INC	66,816	1,080.570	72,199,365.120
ARES MANAGEMENT CORP	23,161	118.670	2,748,515.870
MONGODB INC	10,906	393.150	4,287,693.900
BURLINGTON STORES INC	10,565	196.900	2,080,248.500

VEEVA SYSTEMS INC	23,273	193.890	4,512,401.970
EVERGY INC	33,192	54.080	1,795,023.360
ALLEGION PLC	13,423	122.100	1,638,948.300
CERIDIAN HCM HOLDING INC	22,002	65.340	1,437,610.680
STERIS PLC	14,158	223.990	3,171,250.420
DOCUSIGN INC	26,362	56.110	1,479,171.820
WIX.COM LTD	8,997	122.180	1,099,253.460
DROPBOX INC	41,801	30.210	1,262,808.210
KKR & CO INC	90,373	82.420	7,448,542.660
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	48.230	243,561.500
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	68.180	2,308,370.260
MODERNA INC	50,006	109.460	5,473,656.760
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	182.520	7,343,144.640
CIGNA GROUP	45,163	307.720	13,897,558.360
DELL TECHNOLOGIES INC	38,669	78.250	3,025,849.250
DOW INC	106,037	53.380	5,660,255.060
OVINTIV INC	39,160	41.340	1,618,874.400
AMCOR PLC	223,348	9.760	2,179,876.480
PINTEREST INC	90,936	37.760	3,433,743.360
FOX CORP-A	36,501	30.670	1,119,485.670
FOX CORP-B	27,507	28.500	783,949.500
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	33,813	282.040	9,536,618.520
AVANTOR INC	97,157	22.480	2,184,089.360
DYNATRACE INC	39,362	54.870	2,159,792.940
CLOUDFLARE INC	39,310	80.970	3,182,930.700
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	93.850	1,587,754.300
CARRIER GLOBAL CORP	124,379	57.040	7,094,578.160
OTIS WORLDWIDE CORP	62,600	87.000	5,446,200.000
UBER TECHNOLOGIES INC	276,804	62.410	17,275,337.640
CORTEVA INC	108,001	46.050	4,973,446.050
MATCH GROUP INC	44,764	38.780	1,735,947.920
FERGUSON PLC	30,868	187.140	5,776,637.520
BILL HOLDINGS INC	16,243	76.390	1,240,802.770
BLACKSTONE INC	105,031	121.530	12,764,417.430
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,809	159.580	927,000.220
CARLYLE GROUP INC	34,847	39.500	1,376,456.500
DATADOG INC	38,635	120.190	4,643,540.650
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	82.660	2,553,367.400
VERTIV HOLDINGS CO	53,234	48.790	2,597,286.860
INGERSOLL RAND INC	61,976	76.290	4,728,149.040
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	62,373	76.170	4,750,951.410
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	202.000	1,806,082.000
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	19.070	1,781,633.820
DRAFTKINGS INC	63,900	33.570	2,145,123.000
UNITY SOFTWARE INC	40,967	37.130	1,521,104.710
AON PLC	30,296	299.300	9,067,592.800

WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	10.970	3,855,088.370
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,512.290	1,370,134.740
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	47.570	1,599,969.380
COINBASE GLOBAL INC	26,305	151.290	3,979,683.450
UIPATH INC	53,439	22.740	1,215,202.860
AIRBNB INC	64,456	139.760	9,008,370.560
CONSTELLATION ENERGY CORP	48,214	115.850	5,585,591.900
MONDAY.COM LTD	3,043	192.160	584,742.880
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	28.780	1,789,338.940
ROBLOX CORP	59,573	41.780	2,488,959.940
VIATRIS INC	184,148	12.100	2,228,190.800
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	45.360	1,569,637.440
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	77.180	1,222,994.280
HF SINCLAIR CORP	20,299	52.440	1,064,479.560
SNOWFLAKE INC	42,608	197.400	8,410,819.200
DOORDASH INC	39,376	105.590	4,157,711.840
ARISTA NETWORKS INC	39,238	249.230	9,779,286.740
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	59,548	96.720	5,759,482.560
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	39.460	627,137.780
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	273,108	16.790	4,585,483.320
FNF GROUP	38,907	49.580	1,929,009.060
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	131.950	2,470,499.850
MARVELL TECHNOLOGY INC	129,101	63.430	8,188,876.430
APA CORP	49,146	32.570	1,600,685.220
CONFLUENT INC	27,524	22.670	623,969.080
LINDE PLC	73,237	405.880	29,725,433.560
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	12.140	893,091.240
LUCID GROUP INC	143,927	3.410	490,791.070
U-HAUL HOLDING CO	11,981	64.580	773,732.980
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	201.770	750,786.170
TOAST INC	45,399	19.100	867,120.900
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.320	927,989.800
CATALENT INC	27,357	50.360	1,377,698.520
SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	37.940	2,606,515.940
VERALTO CORP	32,610	76.430	2,492,382.300
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	19,871	30.600	608,052.600
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	28,191	61.890	1,744,740.990
BUNGE GLOBAL SA	21,715	94.910	2,060,970.650
KENVUE INC	264,038	21.770	5,748,107.260
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	33.370	2,436,443.810
CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	218.800	1,487,621.200
KEYSIGHT TECHNOLOGIES	27,713	153.000	4,240,089.000

INC				
HUBSPOT INC	6,836	569.890	3,895,768.040	
QORVO INC	14,144	104.490	1,477,906.560	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,444	76.750	1,415,577.000	
LIBERTY GLOBAL LTD	36,034	19.640	707,707.760	
GODADDY INC	19,713	104.700	2,063,951.100	
ETSY INC	18,558	74.720	1,386,653.760	
TRANSUNION	31,262	67.310	2,104,245.220	
ALBERTSONS COS INC	54,086	23.050	1,246,682.300	
BLOCK INC	84,306	67.900	5,724,377.400	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	76.180	5,198,142.300	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	64.960	2,014,539.520	
WESTROCK CO	34,286	41.860	1,435,211.960	
KRAFT HEINZ CO	129,447	37.890	4,904,746.830	
FORTIVE CORP	50,061	71.820	3,595,381.020	
WASTE CONNECTIONS INC	38,848	148.640	5,774,366.720	
ALPHABET INC-CL A	894,177	142.280	127,223,503.560	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	186,711	16.430	3,067,661.730	
PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	60.960	9,662,586.720	
SEA LTD ADR	58,070	38.390	2,229,307.300	
EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	32.770	1,845,901.330	
ZILLOW GROUP INC-C	22,374	54.600	1,221,620.400	
ALPHABET INC-CL C	783,554	143.800	112,675,065.200	
ZSCALER INC	14,051	225.400	3,167,095.400	
ATLASSIAN CORP PLC	23,713	244.210	5,790,951.730	
ROKU INC	19,331	89.690	1,733,797.390	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,042	367.000	5,153,414.000	
VISTRA CORP	49,633	38.460	1,908,885.180	
アメリカ・ドル 小計	51,008,469		6,201,421,987.780 (903,237,112,519)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	61,295	15.830	970,299.850	
ASHTED GROUP	66,851	49.690	3,321,826.190	
SEVERN TRENT PLC	45,548	26.200	1,193,357.600	
BARCLAYS PLC	2,229,023	1.526	3,401,489.090	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	5.534	687,300.660	
BT GROUP PLC	904,198	1.166	1,054,294.860	
BUNZL PLC	46,691	31.960	1,492,244.360	
CRH PLC	108,593	54.120	5,877,053.160	
AVIVA PLC	429,205	4.274	1,834,422.170	
CRODA INTERNATIONAL	20,573	46.120	948,826.760	
DIAGEO PLC	333,830	27.875	9,305,511.250	
SCHRODERS PLC	110,366	4.232	467,068.910	
DCC PLC	17,471	56.620	989,208.020	
NATIONAL GRID PLC	547,462	10.685	5,849,631.470	
KINGFISHER PLC	336,026	2.246	754,714.390	

BAE SYSTEMS PLC	457,388	11.555	5,285,118.340	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	314,741	23.525	7,404,282.020	
HALMA PLC	51,066	21.770	1,111,706.820	
NEXT PLC	18,588	85.440	1,588,158.720	
IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	18.690	2,358,285.510	
ANGLO AMERICAN PLC	193,117	18.232	3,520,909.140	
COMPASS GROUP PLC	259,074	21.840	5,658,176.160	
HSBC HOLDINGS PLC	2,924,664	6.307	18,445,855.840	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.494	2,135,859.100	
CENTRICA PLC	793,776	1.544	1,225,590.140	
UNILEVER PLC	382,437	38.320	14,654,985.840	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.540	954,597.260	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	23.360	1,285,804.480	
PEARSON PLC	84,159	9.800	824,758.200	
PERSIMMON PLC	56,989	14.785	842,582.360	
PRUDENTIAL PLC	418,146	8.388	3,507,408.640	
RIO TINTO PLC	167,240	55.050	9,206,562.000	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.686	2,457,871.450	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	107,096	56.080	6,005,943.680	
RELX PLC	280,647	31.620	8,874,058.140	
RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.139	1,551,483.450	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,221,103	3.092	3,775,650.470	
NATWEST GROUP PLC	896,355	2.151	1,928,059.600	
ST JAMES' S PLACE PLC	89,082	6.328	563,710.890	
SSE PLC	168,922	18.630	3,147,016.860	
BP PLC	2,571,529	4.564	11,736,458.350	
SAGE GROUP PLC (THE)	152,196	11.585	1,763,190.660	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.915	874,420.920	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	99.960	1,074,669.960	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	6.264	2,270,875.390	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,179,291	0.469	4,305,087.470	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.484	845,676.690	
TESCO PLC	1,030,735	2.964	3,055,098.540	
3I GROUP PLC	139,893	22.970	3,213,342.210	
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	10.785	1,358,155.050	
GSK PLC	626,067	15.708	9,834,260.430	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63,356	90.920	5,760,327.520	
WPP PLC	142,785	7.594	1,084,309.290	
ASTRAZENECA PLC	232,839	109.000	25,379,451.000	
WHITBREAD PLC	31,475	35.500	1,117,362.500	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.900	999,956.100	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	14.030	732,772.870	
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	71.860	1,931,165.640	

	SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.865	761,537.050	
	ADMIRAL GROUP PLC	40,084	25.690	1,029,757.960	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	48.980	807,631.220	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	18.905	348,891.770	
	ABRDN PLC	285,831	1.706	487,627.680	
	EXPERIAN PLC	140,133	31.450	4,407,182.850	
	MONDI PLC	74,310	14.740	1,095,329.400	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.376	272,484.190	
	OCADO GROUP PLC	69,766	6.858	478,455.220	
	INFORMA PLC	223,961	7.852	1,758,541.770	
	GLENCORE PLC	1,570,188	4.479	7,032,872.050	
	ENTAIN PLC	96,924	9.516	922,328.780	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	23.180	719,391.300	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	5.174	702,774.070	
	M&G PLC	270,401	2.245	607,050.240	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	14.640	411,018.000	
	WISE PLC	96,207	8.850	851,431.950	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.133	432,886.440	
	HALEON PLC	836,729	3.372	2,821,450.180	
	SHELL PLC	993,556	24.475	24,317,283.100	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	7.100	1,016,634.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.806	1,254,815.940	
	イギリス・ポンド 小計	40,717,305		276,335,640.400 (51,307,238,353)	
イスラエル・シユケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	31.720	5,944,454.880	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	27.900	6,670,415.700	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	774.200	2,578,086.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	17.850	2,908,550.400	
	ICL GROUP LTD	103,067	18.020	1,857,267.340	
	NICE LTD	9,053	786.500	7,120,184.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	136.700	4,024,994.800	
	AZRIELI GROUP	4,672	238.400	1,113,804.800	
	イスラエル・シユケル 小計	738,997		32,217,758.420 (1,253,702,521)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	51.160	1,448,134.960	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	520,190	22.960	11,943,562.400	
	FORTESCUE LTD	253,090	27.560	6,975,160.400	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.900	2,339,426.700	
	ASX LTD	31,215	62.840	1,961,550.600	
	BHP GROUP LTD	757,775	47.860	36,267,111.500	
	AMPOL LTD	31,828	36.440	1,159,812.320	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	24.670	2,260,364.080	
	CSL LIMITED	72,171	291.860	21,063,828.060	
	REA GROUP LTD	9,317	179.450	1,671,935.650	

TRANSURBAN GROUP	476,258	13.800	6,572,360.400
COCHLEAR LTD	10,446	297.240	3,104,969.040
ORIGIN ENERGY LTD	257,692	8.330	2,146,574.360
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	246,769	112.040	27,647,998.760
RIO TINTO LIMITED	56,991	128.900	7,346,139.900
APA GROUP	164,300	8.550	1,404,765.000
ARISTOCRAT LEISU	86,829	40.100	3,481,842.900
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.680	2,045,265.760
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	54.440	3,308,155.480
IGO LTD	91,947	7.770	714,428.190
ORICA LTD	63,862	15.870	1,013,489.940
BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	22.090	1,691,806.830
MACQUARIE GROUP LTD	56,701	180.260	10,220,922.260
SUNCORP GROUP LTD	199,628	13.600	2,714,940.800
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	465,095	30.720	14,287,718.400
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.430	611,738.370
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	219,807	14.960	3,288,312.720
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	12.690	2,063,762.010
REECE LTD	31,558	21.960	693,013.680
SANTOS LTD	478,809	7.500	3,591,067.500
SONIC HEALTHCARE	64,897	31.820	2,065,022.540
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	32.420	1,277,996.400
WESFARMERS LTD	172,824	57.000	9,850,968.000
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	282,153	30.880	8,712,884.640
WOOLWORTHS GROUP LTD	183,840	36.790	6,763,473.600
SEEK LTD	58,513	25.950	1,518,412.350
MINERAL RESOURCES LTD	28,865	63.000	1,818,495.000
BRAMBLES LTD	220,767	13.690	3,022,300.230
PILBARA MINERALS LTD	404,496	3.690	1,492,590.240
CAR GROUP LTD	58,310	30.560	1,781,953.600
AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.800	846,826.200
TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	10.070	1,358,543.700
XERO LTD	23,149	109.280	2,529,722.720
IDP EDUCATION LTD	44,923	20.750	932,152.250
LOTTERY CORP LTD	291,270	4.550	1,325,278.500
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.450	1,273,338.000
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	443,450	25.830	11,454,313.500
MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.660	1,510,668.660
SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.380	2,307,654.440
COLES GROUP LTD	197,589	16.030	3,167,351.670

	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	71.880	1,531,762.800	
オーストラリア・ドル	小計	10,297,449		251,581,868.010 (24,579,548,505)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	75,291	69.630	5,242,512.330	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	23.220	6,211,233.900	
	BANK OF MONTREAL	109,727	127.750	14,017,624.250	
	BANK OF NOVA SCOTIA	183,639	63.600	11,679,440.400	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	101.090	5,226,959.540	
	BCE INC	14,197	54.720	776,859.840	
	BROOKFIELD CORP	211,045	53.150	11,217,041.750	
	SAPUTO INC	34,582	27.150	938,901.300	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	8.830	815,106.130	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	110.000	1,265,880.000	
	CGI INC	31,091	141.790	4,408,392.890	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	56.960	1,199,463.680	
	CAE INC	40,808	28.280	1,154,050.240	
	CAMECO CORP	66,084	60.420	3,992,795.280	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	63.510	3,389,846.250	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	136,114	63.070	8,584,709.980	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,344	86.350	14,191,104.400	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	144.040	1,283,540.440	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	32.220	526,152.600	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,693	166.400	13,926,515.200	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	42.080	1,268,375.360	
	OPEN TEXT CORP	40,459	55.620	2,250,329.580	
	EMPIRE CO LTD	20,608	35.050	722,310.400	
	KINROSS GOLD CORP	192,737	7.520	1,449,382.240	
	RB GLOBAL INC	26,641	87.620	2,334,284.420	
	FORTIS INC	72,078	55.880	4,027,718.640	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	12.540	1,071,179.340	
	TELUS CORP	31,890	24.460	780,029.400	
	GREAT WEST LIFECO INC	43,551	43.320	1,886,629.320	
	IMPERIAL OIL LTD	27,434	77.450	2,124,763.300	
	ENBRIDGE INC	314,754	49.350	15,533,109.900	
	IGM FINANCIAL INC	12,478	35.330	440,847.740	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	271,363	28.930	7,850,531.590	
	LOBLAW CO LTD	24,803	127.590	3,164,614.770	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	116,251	80.360	9,341,930.360	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	75.980	3,212,358.420	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	84,814	68.480	5,808,062.720	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,133	1,250.850	3,918,913.050	
	METRO INC	35,059	68.320	2,395,230.880	
	EMERA INC	44,643	51.490	2,298,668.070	

ONEX CORP	10,157	92.380	938,303.660
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	20.110	1,113,551.030
POWER CORP OF CANADA	89,864	38.390	3,449,878.960
QUEBECOR INC-B	30,598	31.970	978,218.060
ROYAL BANK OF CANADA	208,784	134.640	28,110,677.760
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	138,820	105.580	14,656,615.600
STANTEC INC	18,358	107.610	1,975,504.380
SUNCOR ENERGY INC	198,439	43.390	8,610,268.210
LUNDIN MINING CORP	77,139	10.620	819,216.180
TECK RESOURCES LTD-CL B	65,896	51.800	3,413,412.800
THOMSON REUTERS CORP	24,837	193.620	4,808,939.940
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	115.430	1,511,786.710
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	270,486	81.900	22,152,803.400
TC ENERGY CORP	157,154	53.060	8,338,591.240
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	114.140	924,762.280
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	166.990	1,643,014.610
INTACT FINANCIAL CORP	26,758	205.010	5,485,657.580
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	66,562	64.570	4,297,908.340
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,041	3,477.600	10,575,381.600
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	141.910	4,174,992.200
TOURMALINE OIL CORP	49,085	60.190	2,954,426.150
KEYERA CORP	39,997	32.020	1,280,703.940
PARKLAND CORP	15,665	45.060	705,864.900
ALTAGAS LTD	47,249	28.620	1,352,266.380
PEMBINA PIPELINE CORP	82,164	45.870	3,768,862.680
DOLLARAMA INC	41,508	97.140	4,032,087.120
MEG ENERGY CORP	47,181	23.100	1,089,881.100
CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	21.590	4,895,899.530
ARC RESOURCES LTD	96,301	20.540	1,978,022.540
NORTHLAND POWER INC	34,152	25.160	859,264.320
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	22.230	1,139,131.890
TMX GROUP LTD	46,884	31.950	1,497,943.800
BRP INC	4,307	92.330	397,665.310
IVANHOE MINES LTD	98,820	13.380	1,322,211.600
NUTRIEN LTD	77,339	71.300	5,514,270.700
TFI INTERNATIONAL INC	11,591	178.930	2,073,977.630
WSP GLOBAL INC	17,782	187.800	3,339,459.600
IA FINANCIAL CORP INC	16,448	88.390	1,453,838.720
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	43.790	1,561,857.930
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	40.700	655,392.100
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	52.580	2,747,252.420
AIR CANADA	41,858	19.620	821,253.960

	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	105.220	4,746,789.860	
	SHOIFY INC	179,237	108.460	19,440,045.020	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	215.040	1,126,164.480	
	HYDRO ONE LTD	46,225	38.950	1,800,463.750	
カナダ・ドル	小計	6,122,743		382,461,881.870 (41,646,274,317)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.830	657,994.000	
	SEBNCORP INDUSTRIES	162,200	5.470	887,234.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	268,710	32.510	8,735,762.100	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,000	6.470	653,470.000	
	SEATRUM LTD	7,235,222	0.111	803,109.640	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	28.770	445,935.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.780	1,368,222.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	1.000	761,193.000	
	KEPPEL LTD	184,900	6.960	1,286,904.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	502,098	12.830	6,441,917.340	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	2.380	3,191,175.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.540	1,595,760.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	28.230	5,407,908.180	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.230	271,628.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.460	894,410.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	3.010	1,219,922.900	
シンガポール・ドル	小計	12,026,309		34,622,545.560 (3,789,437,612)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	81.280	1,929,099.520	
	NESTLE SA-REGISTERED	401,274	98.270	39,433,195.980	
	CIE FINANC RICHEMONT	77,733	112.300	8,729,415.900	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	105,427	253.900	26,767,915.300	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	206.800	1,098,314.800	
	SIKA INHABER	23,397	244.000	5,708,868.000	
	SGS SA-REG	22,978	70.320	1,615,812.960	
	NOVARTIS AG-REG SHS	307,129	91.550	28,117,659.950	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	129.900	757,317.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,325.000	609,500.000	
	CLARIANT AG-REG	22,909	11.500	263,453.500	
	SWISSCOM AG-REG	4,457	509.600	2,271,287.200	
	ABB LTD	238,635	36.350	8,674,382.250	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	38.630	1,021,918.020	
	GEBERIT AG	5,105	516.200	2,635,201.000	
	LONZA GROUP AG-REG	10,855	364.300	3,954,476.500	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,250.000	1,404,250.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	103,000.000	1,648,000.000	

	GIVAUDAN-REG	1,392	3,396.000	4,727,232.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,160	435.900	9,659,544.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	273.800	1,316,978.000	
	HOLCIM LTD	77,519	64.560	5,004,626.640	
	TEMENOS GROUP	10,930	77.740	849,698.200	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	61.850	289,025.050	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	278.000	2,251,800.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	291.800	2,302,302.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,475	129.700	2,136,807.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	217.800	936,540.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	41.700	386,100.300	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	117.400	575,964.400	
	SCHINDLER NAMEN	4,209	195.000	820,755.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	587.400	2,645,062.200	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	108.700	532,956.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	657.000	817,965.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,356	89.800	1,199,368.800	
	AVOLTA AG	12,933	32.550	420,969.150	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,163.500	3,994,295.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	47.200	1,515,780.800	
	SWISS RE LTD	45,502	96.740	4,401,863.480	
	BKW AG	3,194	152.600	487,404.400	
	SIG GROUP AG	50,969	18.530	944,455.570	
	ALCON INC	74,922	68.560	5,136,652.320	
	SANDOZ GROUP AG	57,347	28.660	1,643,565.020	
	UBS GROUP AG	487,869	25.460	12,421,144.740	
	VAT GROUP AG	4,131	400.600	1,654,878.600	
スイス・フラン	小計	2,254,885		205,713,802.650 (35,228,488,704)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	396,072	163.750	64,856,790.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	141.150	34,139,809.350	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	63.200	26,417,600.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	229.600	5,913,348.000	
	LUNDBERGS B	14,872	537.400	7,992,212.800	
	SKF AB-B SHS	46,594	198.100	9,230,271.400	
	SANDVIK AB	169,218	210.100	35,552,701.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	141.850	31,540,063.800	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	174.450	7,664,809.650	
	SWEDBANK AB	132,581	206.000	27,311,686.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	145.000	13,455,275.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	109.200	23,897,983.200	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	253.800	6,141,452.400	
	VOLVO AB-B SHS	237,569	248.350	59,000,261.150	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	410.100	7,102,932.000	

TELE2 AB-B SHS	67,654	88.920	6,015,793.680	
INDUSTRIVARDEN A	15,292	325.500	4,977,546.000	
INDUSTRIVARDEN C	21,325	325.900	6,949,817.500	
SAAB AB-B	11,789	650.600	7,669,923.400	
SECURITAS AB-B SHS	76,085	97.120	7,389,375.200	
INVESTOR AB-B SHS	271,548	229.100	62,211,646.800	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	167.740	17,557,178.060	
ASSA ABLOY AB-B	153,368	283.300	43,449,154.400	
TELIA CO AB	344,810	27.180	9,371,935.800	
BOLIDEN AB	36,260	287.350	10,419,311.000	
ALFA LAVAL AB	44,407	383.700	17,038,965.900	
FASTIGHETS AB BALDER	72,942	69.320	5,056,339.440	
INDUTRADE AB	39,178	253.800	9,943,376.400	
HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	79.640	3,804,323.160	
NIBE INDUSTRIER AB	212,832	65.140	13,863,876.480	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	279.600	10,172,127.600	
HEXAGON AB-B SHS	307,116	116.600	35,809,725.600	
SAGAX AB	28,022	262.900	7,366,983.800	
EPIROC AB-A	103,115	188.100	19,395,931.500	
EPIROC AB-B	61,487	166.200	10,219,139.400	
ESSITY AB-B	86,900	257.600	22,385,440.000	
EQT AB	55,194	260.200	14,361,478.800	
VOLVO CAR AB	63,710	30.790	1,961,630.900	
BEIJER REF AB	50,493	126.600	6,392,413.800	
LIFCO AB	39,631	247.400	9,804,709.400	
EVOLUTION AB	28,266	1,170.000	33,071,220.000	
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	254.600	7,036,634.800	
スウェーデン・クローナ 小計	4,709,855		763,913,195.370 (10,878,123,902)	
デンマーク・ク ローネ				
CARLSBERG AS-B	15,167	864.600	13,113,388.200	
A P MOLLER A/S	663	12,955.000	8,589,165.000	
AP MOLLER MAERSK A	543	12,730.000	6,912,390.000	
DANSKE BANK A/S	102,303	190.600	19,498,951.800	
GENMAB A/S	9,783	2,199.000	21,512,817.000	
NOVOZYMES-B SHS	29,795	363.200	10,821,544.000	
ROCKWOOL AS	873	1,890.000	1,649,970.000	
NOVO NORDISK A/S-B	489,820	737.900	361,438,178.000	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	202.800	31,336,858.800	
COLOPLAST-B	21,291	784.000	16,692,144.000	
DSV A/S	28,190	1,234.500	34,800,555.000	
DEMANT A/S	11,367	298.100	3,388,502.700	
TRYG A/S	58,222	145.550	8,474,212.100	
PANDORA A/S	12,473	998.200	12,450,548.600	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	16,295	553.200	9,014,394.000	
ORSTED A/S	26,911	379.100	10,201,960.100	
デンマーク・クローネ 小計	978,217		569,895,579.300 (12,212,862,264)	

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.570	1,408,402.370	
	EBOS GROUP LTD	25,631	35.710	915,283.010	
	FISHER & PAYKEL	78,460	23.740	1,862,640.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	5.185	1,621,468.750	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.550	411,562.700	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.640	1,349,697.120	
ニュージーランド・ドル 小計		883,297		7,569,054.350 (687,497,207)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	186.700	13,651,130.600	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	66.120	14,624,553.840	
	TELENOR ASA	119,576	120.750	14,438,802.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	499.800	5,590,263.000	
	ORKLA ASA	116,068	82.000	9,517,576.000	
	EQUINOR ASA	129,895	313.150	40,676,619.250	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	353.300	7,007,352.200	
	AKER BP ASA	40,933	285.000	11,665,905.000	
	SALMAR ASA	12,897	584.800	7,542,165.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	182.800	4,701,798.800	
	ADEVINTA ASA	54,715	112.300	6,144,494.500	
	DNB BANK ASA	143,909	214.600	30,882,871.400	
ノルウェー・クローネ 小計		969,033		166,443,532.190 (2,341,860,498)	
ユーロ	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	27,104	148.650	4,029,009.600	
	KERRY GROUP PLC-A	25,025	76.700	1,919,417.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	73.900	1,615,454.000	
	UMICORE	33,545	22.070	740,338.150	
	AIR LIQUIDE	77,642	171.460	13,312,497.320	
	AIRBUS SE	88,164	144.040	12,699,142.560	
	AXA SA	271,713	29.535	8,025,043.450	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	98,192	28.880	2,835,784.960	
	ADIDAS AG	24,550	179.380	4,403,779.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	19.735	2,853,937.550	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	185.600	579,072.000	
	DANONE	96,532	61.060	5,894,243.920	
	SAFRAN SA	51,062	163.620	8,354,764.440	
	INTESA SANPAOLO	2,330,103	2.748	6,403,123.040	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,783	99.900	4,973,321.700	
	ACCOR SA	31,427	34.870	1,095,859.490	
	BOUYGUES	29,123	35.570	1,035,905.110	
	BNP PARIBAS	155,810	62.430	9,727,218.300	
	THALES SA	15,023	138.400	2,079,183.200	
	CAPGEMINI SA	25,063	182.450	4,572,744.350	
LOTUS BAKERIES NV	77	7,740.000	595,980.000		
UNICREDIT SPA	244,666	25.865	6,328,286.090		
BE SEMICONDUCTOR	12,403	127.550	1,582,002.650		

INDUSTRIES NV				
D' IETEREN TRDG	2,736	172.900	473,054.400	
COMMERZBANK AG	158,792	11.495	1,825,314.040	
EIFFAGE	12,706	97.500	1,238,835.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	28.520	1,677,375.280	
PUBLICIS GROUPE	33,467	85.140	2,849,380.380	
IBERDROLA SA	899,504	11.605	10,438,743.920	
ENI SPA	353,207	14.884	5,257,132.980	
JERONIMO MARTINS	45,606	22.280	1,016,101.680	
KESKO OYJ-B	35,252	18.305	645,287.860	
KBC GROUPE	35,962	59.820	2,151,246.840	
HANNOVER RUECK SE	8,405	222.900	1,873,474.500	
WARTSILA OYJ	77,148	13.530	1,043,812.440	
L' OREAL	36,699	440.000	16,147,560.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	41,589	683.000	28,405,287.000	
GEA GROUP AG	25,513	36.220	924,080.860	
BOLLORE	114,808	5.715	656,127.720	
MEDIOBANCA SPA	86,792	11.235	975,108.120	
MICHELIN (CGDE) -B	98,359	31.350	3,083,554.650	
CONTINENTAL AG	17,635	74.220	1,308,869.700	
DEUTSCHE POST AG-REG	151,735	44.755	6,790,899.920	
OMV AG	23,354	38.500	899,129.000	
VERBUND AG	10,663	86.250	919,683.750	
PERNOD-RICARD	30,948	148.800	4,605,062.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	46.330	1,079,998.630	
RENAULT SA	27,902	35.905	1,001,821.310	
REPSOL SA	195,049	12.930	2,521,983.570	
REMY COINTREAU	2,866	95.280	273,072.480	
MERCK KGAA	18,505	143.050	2,647,140.250	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	69,501	62.770	4,362,577.770	
RWE AG	98,751	40.770	4,026,078.270	
SEB SA	2,596	111.400	289,194.400	
SOCIETE GENERALE-A	104,069	24.425	2,541,885.320	
VINCI S. A.	76,313	115.060	8,780,573.780	
SODEXO	12,910	103.850	1,340,703.500	
SOFINA	2,281	217.800	496,801.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	81,059	174.180	14,118,856.620	
VIVENDI SE	98,944	9.866	976,181.500	
SAP SE	157,400	142.040	22,357,096.000	
TELEFONICA S. A	755,720	3.710	2,803,721.200	
TOTALENERGIES SE	341,670	59.770	20,421,615.900	
E. ON SE	339,366	12.610	4,279,405.260	
VOEST-ALPINE AG	18,032	26.700	481,454.400	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	65.800	1,176,898.800	
SIEMENS AG-REG	113,016	160.780	18,170,712.480	
UPM-KYMMENE OYJ	77,973	34.520	2,691,627.960	
ING GROEP NV-CVA	540,815	12.934	6,994,901.210	

PUMA AG	17,210	47.480	817,130.800
BAYER AG	147,329	34.760	5,121,156.040
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	12.205	1,171,435.900
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	73.660	1,781,909.060
MERCEDES-BENZ GROUP AG	119,618	62.960	7,531,149.280
BASF SE	135,442	45.020	6,097,598.840
BEIERSDORF AG	15,743	138.050	2,173,321.150
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	85.260	1,840,422.360
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	36.810	1,237,993.920
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	445.350	2,962,022.850
ORANGE	286,957	10.544	3,025,674.600
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	39.270	2,516,421.600
RANDSTAD NV	15,584	52.200	813,484.800
ALLIANZ SE	61,413	242.200	14,874,228.600
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	4.578	2,313,908.890
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	26.695	3,915,275.560
HERMES INTL	4,712	1,854.000	8,736,048.000
ENDESA S. A.	50,946	18.970	966,445.620
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.814	565,280.380
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	38.440	2,174,704.560
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	20,381	379.600	7,736,627.600
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	24.720	2,005,508.880
DASSAULT SYSTEMES SA	101,597	42.765	4,344,795.700
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	39.430	1,373,583.480
RHEINMETALL STAMM	6,662	306.000	2,038,572.000
HEINEKEN NV	43,759	91.040	3,983,819.360
AKZO NOBEL	26,032	70.260	1,829,008.320
ASML HOLDING NV	60,741	651.400	39,566,687.400
AEGON LTD	232,433	5.252	1,220,738.110
VOLKSWAGEN AG	3,315	122.600	406,419.000
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	113.380	3,449,586.500
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	885,310	8.402	7,438,374.620
KERING	11,443	381.700	4,367,793.100
ACCIONA S. A.	5,005	128.600	643,643.000
FORTUM OYJ	54,194	13.795	747,606.230
AGEAS	24,086	39.900	961,031.400
UCB SA	16,732	82.580	1,381,728.560
NEMETSCHEK SE	10,222	75.620	772,987.640
CARREFOUR SA	90,642	16.490	1,494,686.580
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.920	475,864.840
NOKIA OYJ	827,068	3.190	2,638,346.920
KONINKLIJKE PHILIPS NV	121,772	21.895	2,666,197.940
WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	130.500	5,053,482.000
SANOFI	174,457	94.850	16,547,246.450

STMICROELECTRONICS NV	104,058	40.295	4,193,017.110
ELISA OYJ	20,242	42.490	860,082.580
BANCO SANTANDER SA	2,412,875	3.849	9,287,155.870
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	14.765	968,421.580
QIAGEN N.V.	35,613	40.780	1,452,298.140
DEUTSCHE BANK AG-REG	282,637	12.750	3,603,621.750
BMW VORZUG	7,821	91.450	715,230.450
ENEL SPA	1,202,825	6.737	8,103,432.020
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	482,293	22.455	10,829,889.310
SARTORIUS AG	3,651	315.300	1,151,160.300
LEONARDO SPA	64,915	16.635	1,079,861.020
INFINEON TECHNOLOGIES AG	197,936	34.785	6,885,203.760
RATIONAL AG	542	665.000	360,430.000
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	101.050	491,709.300
BECHTLE AG	14,521	43.770	635,584.170
KONINKLIJKE KPN NV	496,095	3.121	1,548,312.490
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	57.580	1,326,528.040
TELEPERFORMANCE	7,845	128.000	1,004,160.000
DEUTSCHE BOERSE AG	28,751	186.400	5,359,186.400
EURAZEO	5,673	70.650	400,797.450
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	70.320	908,393.760
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	76.050	1,345,324.500
INDITEX	162,141	38.260	6,203,514.660
ESSILORLUXOTTICA	43,937	184.400	8,101,982.800
SNAM SPA	317,518	4.783	1,518,688.590
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	13.260	2,213,372.460
ENAGAS	38,270	15.630	598,160.100
TENARIS SA	76,002	14.770	1,122,549.540
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.286	259,769.790
TERNA SPA	207,655	7.564	1,570,702.420
BIOMERIEUX	4,870	100.150	487,730.500
GRIFOLS SA	31,982	11.815	377,867.330
NESTE OYJ	66,248	31.970	2,117,948.560
RECORDATI SPA	18,197	49.100	893,472.700
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	9.278	778,795.320
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	202.400	1,759,260.800
KONE OYJ	49,300	45.560	2,246,108.000
ELIA GROUP	4,078	114.700	467,746.600
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	236.600	912,093.000
ENGIE	277,054	16.502	4,571,945.100
ALSTOM	47,494	11.695	555,442.330
IPSEN SA	5,964	105.400	628,605.600
ARKEMA SA	10,489	97.640	1,024,145.960
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	101.900	304,782.900
LEGRAND SA	41,105	89.540	3,680,541.700
AMPLIFON SPA	20,249	31.400	635,818.600
ADP	3,975	116.900	464,677.500

ORION OYJ	13,559	41.990	569,342.410
METSO CORPORATION	102,831	8.964	921,777.080
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	14.980	1,192,183.300
SYMRISE AG	19,547	97.660	1,908,960.020
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	35.370	1,410,166.530
PRYSMIAN SPA	38,343	40.410	1,549,440.630
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	90.380	219,533.020
CAIXABANK	630,095	3.866	2,435,947.270
BUREAU VERITAS SA	39,729	22.660	900,259.140
GETLINK	63,968	16.230	1,038,200.640
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	17.140	680,252.320
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	64.600	4,447,580.800
BRENTAG SE	21,559	82.040	1,768,700.360
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	17.525	750,700.900
EDENRED	35,618	54.880	1,954,715.840
TALANX AG	10,349	65.350	676,307.150
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	75.420	898,629.300
VONOVIA SE	107,478	27.530	2,958,869.340
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	8.548	1,403,205.480
KNORR-BREMSE AG	10,342	59.100	611,212.200
OCI NV	12,329	25.110	309,581.190
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	52.620	2,365,900.440
FERRARI NV	18,850	316.900	5,973,565.000
ASR NEDERLAND NV	27,365	42.640	1,166,843.600
AIB GROUP PLC	226,914	3.950	896,310.300
NORDEA BANK ABP	492,403	11.488	5,656,725.660
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	32.680	565,135.240
MONCLER SPA	29,763	54.300	1,616,130.900
NEXI SPA	83,576	7.250	605,926.000
PROSUS NV	220,842	26.720	5,900,898.240
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	77.320	1,420,445.720
JDE PEET'S BV	14,385	23.960	344,664.600
EXOR NV	14,142	89.400	1,264,294.800
SIEMENS ENERGY AG	74,892	12.255	917,801.460
EURONEXT NV	14,077	77.900	1,096,598.300
IMCD NV	9,332	150.900	1,408,198.800
WORLDLINE SA	36,232	14.235	515,762.520
NN GROUP NV	36,289	37.700	1,368,095.300
FINECOBANK SPA	96,393	13.870	1,336,970.910
ARGENX SE	9,078	361.300	3,279,881.400
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	125,611	25.640	3,220,666.040
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,616	32.840	2,483,229.440
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	25.640	251,836.080
DSM-FIRMENICH AG	28,846	88.830	2,562,390.180
SYENSQO SA	11,217	93.220	1,045,648.740
IBERDROLA SA-RTS	899,504	0.199	179,001.290

	ZALANDO SE	31,321	18.870	591,027.270	
	STELLANTIS NV	327,741	20.780	6,810,457.980	
	FERROVIAL SE	73,817	34.280	2,530,446.760	
	AENA SME SA	11,603	166.000	1,926,098.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	81,974	35.310	2,894,501.940	
	BANCO BPM SPA	202,727	4.877	988,699.570	
	ABN AMRO BANK NV	75,982	13.285	1,009,420.870	
	SCOUT24 SE	10,048	66.580	668,995.840	
	COVESTRO AG	27,558	50.380	1,388,372.040	
	HELLOFRESH SE	17,856	13.460	240,341.760	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	129,506	60.090	7,782,015.540	
	POSTE ITALIANE SPA	61,361	10.205	626,189.000	
	AMUNDI SA	11,288	62.750	708,322.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	11.495	481,399.100	
	ADYEN NV	3,176	1,152.000	3,658,752.000	
	DELIVERY HERO SE	22,564	23.495	530,141.180	
	ユーロ 小計	27,607,825		723,364,671.260 (115,600,908,114)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	10.320	2,652,240.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	62.800	15,184,788.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	42.800	3,993,839.200	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	183,491	245.400	45,028,691.400	
	MTR CORP	207,441	27.500	5,704,627.500	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	85.450	10,433,103.200	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	22.500	6,704,370.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	44.550	9,481,131.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	22.450	4,534,900.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.900	9,064,795.400	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	40.550	13,661,457.200	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	19.700	13,405,751.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	10.980	1,900,264.680	
	SINO LAND CO	659,200	8.190	5,398,848.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	79.200	16,201,548.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	64.450	3,417,139.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	87.900	18,912,212.400	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	7.750	1,379,500.000	
	AIA GROUP LTD	1,729,116	62.450	107,983,294.200	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	9.220	7,349,593.920	
	SANDS CHINA LTD	335,800	22.250	7,471,550.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	12.700	1,778,000.000	

	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	15.340	3,092,544.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	23.600	6,044,786.000	
	ESR GROUP LTD	465,200	10.920	5,079,984.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	13.140	3,482,100.000	
	WH GROUP LTD	1,001,000	4.940	4,944,940.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	40.800	15,073,356.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	37.300	9,929,073.500	
香港・ドル	小計	11,681,369		359,288,428.900 (6,693,543,430)	
合計		169,995,753		1,209,456,597,946 (1,209,456,597,946)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル	小計	2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券	合計		2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,252,875.960	
		GOODMAN GROUP	255,895.000	6,215,689.550	
		GPT GROUP	349,447.000	1,607,456.200	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	964,008.430	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,443,343.840	
		STOCKLAND	369,843.000	1,645,801.350	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,118,572.250	
	オーストラリア・ドル	小計	2,985,154.000	15,247,747.580 (1,489,704,938)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,558,717.380	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,784,347.760	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		474,100.000	777,524.000		
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		405,500.000	612,305.000		
シンガポール・ドル	小計	2,277,909.000	4,732,894.140 (518,015,264)		
投資信託受益証券	合計	5,263,063	2,007,720,202 (2,007,720,202)		
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,234.000	3,129,336.420	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,843,979.200	
		AMERICAN TOWER CORP	69,325.000	14,486,845.250	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,564,955.630	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,518.000	3,953,071.780	
	BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,763,769.110	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,660,329.030	
	CROWN CASTLE INC	65,066.000	7,379,135.060	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	45,607.000	6,226,723.710	
	EQUINIX INC	13,861.000	11,149,649.790	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,913,301.900	
	EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,338,757.840	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,452,276.840	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	5,360,791.200	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,644,854.190	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,133.000	1,799,956.010	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	2,179,592.100	
	INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,956,764.270	
	IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	2,930,122.880	
	KIMCO REALTY	95,524.000	2,002,183.040	
	MID AMERICA	17,537.000	2,325,055.460	
	PROLOGIS INC	139,674.000	18,653,462.700	
	PUBLIC STORAGE	23,534.000	6,947,707.480	
	REALTY INCOME CORP	109,733.000	6,486,317.630	
	REGENCY CENTERS CORP	21,907.000	1,412,125.220	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	4,016,826.930	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	48,901.000	7,074,996.680	
	SUN COMMUNITIES INC	18,509.000	2,516,298.550	
	UDR INC	50,449.000	1,928,160.780	
	VENTAS INC	60,757.000	2,955,828.050	
	VICI PROPERTIES INC	152,711.000	4,811,923.610	
	WELLTOWER INC	77,707.000	7,050,356.110	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,461,316.450	
	WP CAREY INC	32,996.000	2,201,823.080	
	アメリカ・ドル 小計	1,871,895.000	151,578,593.980 (22,077,422,214)	
イギリス・ポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	837,765.880	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,438,515.830	
	イギリス・ポンド 小計	286,426.000	2,276,281.710 (422,637,225)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	409,410.680	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	269,728.800	
	カナダ・ドル 小計	23,146.000	679,139.480 (73,951,498)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	234,657.120	
	GECINA SA	8,697.000	925,360.800	
	KLEPIERRE	36,407.000	893,063.710	

		UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	18,477.000	1,222,438.320	
		WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	553,209.160	
	ユーロ	小計	88,793.000	3,828,729.110 (611,869,199)	
	香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	17,429,930.000	
	香港・ドル	小計	410,116.000	17,429,930.000 (324,719,596)	
投資証券	合計		2,680,376	23,510,599,732 (23,510,599,732)	
合計				25,518,319,934 (25,518,319,934)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証 券 時価比 率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 588銘柄 投資証券 34銘柄	71.76	—	—	— 1.75	74.93
イギリス・ポンド	株式 80銘柄 投資証券 2銘柄	4.08	—	—	— 0.03	4.19
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	—	—	—	0.10
オーストラリア・ドル	株式 51銘柄 投資信託受益証 券 7銘柄	1.95	—	— 0.12	—	2.11
カナダ・ドル	株式 86銘柄 新株予約権証券 1銘柄 投資証券 2銘柄	3.31	— 0.00	—	— 0.01	3.38
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資信託受益証 券 4銘柄	0.30	—	— 0.04	—	0.35
スイス・フラン	株式 45銘柄	2.80	—	—	—	2.85
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	0.86	—	—	—	0.88
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.97	—	—	—	0.99
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.05	—	—	—	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 222銘柄 投資証券 5銘柄	9.18	—	—	— 0.05	9.41
香港・ドル	株式 29銘柄 投資証券 1銘柄	0.53	—	—	— 0.03	0.57

(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)

2024年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,958,800,883
コール・ローン	355,190,866
国債証券	94,709,525,097
未収利息	1,043,997,419
前払費用	346,823,656
流動資産合計	98,414,337,921
資産合計	98,414,337,921
負債の部	
流動負債	
未払金	979,537,032
未払解約金	4,591,000
流動負債合計	984,128,032
負債合計	984,128,032
純資産の部	
元本等	
元本	43,108,629,278
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	54,321,580,611
元本等合計	97,430,209,889
純資産合計	97,430,209,889
負債純資産合計	98,414,337,921

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7月12日 至 2024年1月11日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2024年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	60,615,089,140円
同期中追加設定元本額	30,887,733,792円
同期中一部解約元本額	48,394,193,654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)	84,978,240円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,138,545,187円
たわらノーロード バランス (堅実型)	190,962,852円
たわらノーロード バランス (標準型)	593,695,880円
たわらノーロード バランス (積極型)	269,849,763円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	479,249円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	4,873,130円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	67,873,716円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	5,090,952円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	7,769,887円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	66,803,835円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	271,810,079円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	409,557,576円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	794,325,757円
投資のソムリエ	13,214,442,947円
クルーズコントロール	339,862,214円
投資のソムリエ<DC年金>	1,271,156,358円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	308,073,145円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,430,371,755円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,762,496,820円
ワールドアセットバランス (基本コース)	365,283,783円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	790,241,150円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	64,820,223円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	32,817,248円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	12,230,676円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	243,947,771円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	897,164,068円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	226,950,242円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	94,125,468円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	35,579,539円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	21,721,137円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	5,181,361円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	2,110,115円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	20,715,333円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	9,091,771,409円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	413,316,399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）	523,182,615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）	140,152,539円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）	5,634,922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）	107,045,267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）	65,487,134円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,716,131,537円
計	43,108,629,278円
2. 受益権の総数	43,108,629,278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7月12日 至 2024年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 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</p>

	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	2024年1月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	2,776,193,749
合計	2,776,193,749

(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2024年1月11日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,260円 (22,601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

2024年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT' L 1.625 06/02/28	3,000,000.000	2,659,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.7 03/02/31	5,000,000.000	4,181,370.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 1.875 09/15/31	8,000,000.000	6,691,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.125 09/30/24	8,000,000.000	7,807,272.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.5 04/16/25	8,000,000.000	7,748,112.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.5 09/30/29	3,000,000.000	2,721,330.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,385,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT' L	6,000,000.000	5,587,140.000	

3.125 04/16/30			
ABU DHABI GOVT INT' L 3.125 09/30/49	5,000,000.000	3,502,465.000	
ABU DHABI GOVT INT' L 3.875 04/16/50	5,000,000.000	4,021,360.000	
BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	8,685,156.240	
BRAZIL 3.75 09/12/31	15,000,000.000	13,240,272.150	
BRAZIL 3.875 06/12/30	7,000,000.000	6,358,092.510	
BRAZIL 4.5 05/30/29	6,000,000.000	5,761,042.140	
BRAZIL 4.75 01/14/50	7,000,000.000	5,266,876.370	
BRAZIL 6.0 10/20/33	8,000,000.000	7,935,790.160	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,679,858.840	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,674,823.560	
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	975,429.850	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	6,000,000.000	4,953,568.620	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	6,000,000.000	4,763,878.440	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	11,000,000.000	8,518,224.550	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	4,000,000.000	2,506,439.120	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	1,000,000.000	975,324.930	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	4,000,000.000	2,956,082.680	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	8,000,000.000	8,164,237.200	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	5,000,000.000	5,289,092.650	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	6,000,000.000	5,452,501.680	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	7,000,000.000	6,256,252.660	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	12,000,000.000	11,613,862.440	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	6,000,000.000	5,069,224.260	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	6,200,000.000	5,986,716.210	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	10,000,000.000	9,261,192.900	
HUNGARY 2.125 09/22/31	13,000,000.000	10,295,493.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	3,834,900.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	8,000,000.000	7,945,048.000	
HUNGARY 5.375 03/25/24	3,380,000.000	3,378,894.740	
HUNGARY 6.125 05/22/28	6,000,000.000	6,192,000.000	
HUNGARY 6.25 09/22/32	9,000,000.000	9,445,500.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,627,319.070	
INDONESIA 3.05 03/12/51	4,000,000.000	2,872,780.880	
INDONESIA 3.4 09/18/29	200,000.000	187,144.390	
INDONESIA 3.5 01/11/28	1,200,000.000	1,145,723.010	
INDONESIA 3.85 10/15/30	9,400,000.000	8,883,153.970	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,179,513.420	
INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	6,016,649.520	

INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,582,476.460	
INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	998,750.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	500,000.000	626,471.300	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	6,000,000.000	6,048,624.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	7,000,000.000	7,160,384.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	4,000,000.000	4,137,212.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	6,000,000.000	4,269,440.100	
PANAMA 3.16 01/23/30	10,000,000.000	8,366,452.900	
PANAMA 3.87 07/23/60	4,000,000.000	2,297,134.560	
PANAMA 4.5 01/19/63	8,000,000.000	5,049,111.680	
PANAMA 4.5 04/01/56	8,000,000.000	5,173,440.800	
PANAMA 6.4 02/14/35	5,000,000.000	4,745,577.100	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,018,508.350	
PERU 2.392 01/23/26	3,000,000.000	2,844,000.000	
PERU 2.78 12/01/60	4,000,000.000	2,371,984.240	
PERU 2.783 01/23/31	5,000,000.000	4,292,499.800	
PERU 3.0 01/15/34	11,000,000.000	9,055,750.000	
PERU 3.55 03/10/51	7,000,000.000	5,092,579.520	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	1,600,000.000	1,291,026.140	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	6,000,000.000	4,038,298.320	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	1,000,000.000	940,092.080	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	6,000,000.000	4,356,373.740	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	4,200,000.000	4,025,479.660	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	4,200,000.000	3,621,250.540	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	6,200,000.000	5,270,228.340	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	4,000,000.000	3,262,290.040	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	5,200,000.000	4,890,761.510	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	4,000,000.000	2,570,096.680	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	11,000,000.000	8,159,217.110	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	5,000,000.000	3,689,564.450	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	6,200,000.000	5,438,738.390	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,670,164.000	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	5,000,000.000	4,360,545.000	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	8,000,000.000	7,866,211.680	

REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	2,000,000.000	2,133,000.000	
ROMANIA 3.0 02/14/31	3,000,000.000	2,501,772.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	13,000,000.000	9,069,450.000	
ROMANIA 6.625 02/17/28	3,000,000.000	3,081,153.000	
ROMANIA 7.125 01/17/33	14,000,000.000	14,804,776.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	11,000,000.000	8,861,545.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	6,000,000.000	5,785,230.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	12,200,000.000	11,108,917.400	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	2,000,000.000	1,327,568.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	3,400,000.000	2,439,806.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	12,000,000.000	11,786,760.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,931,168.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	3,299,360.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	6,000,000.000	6,006,240.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	5,000,000.000	4,983,930.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	3,000,000.000	2,675,049.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	5,000,000.000	4,661,790.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	7,000,000.000	7,291,109.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	12,000,000.000	11,029,980.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	1,400,000.000	1,373,454.600	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	13,000,000.000	9,874,592.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	2,000,000.000	1,896,280.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	9,000,000.000	8,110,584.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,846,000.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	8,000,000.000	7,729,304.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	12,000,000.000	11,816,544.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	7,000,000.000	6,155,800.000	
STATE OF QATAR 4.817	16,000,000.000	14,990,816.000	

	03/14/49			
	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	2,000,000.000	1,940,600.000	
	UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	5,000,000.000	3,454,745.000	
	UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	3,000,000.000	2,918,496.000	
	UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	1,000,000.000	1,036,825.000	
	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	8,000,000.000	6,720,344.960	
	UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	5,000,000.000	4,501,364.550	
	UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	7,000,000.000	5,859,715.050	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	4,000,000.000	2,600,317.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,639,209.520	
	UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,570,092.560	
	UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	8,000,000.000	6,485,903.440	
	UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	3,000,000.000	2,326,969.170	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	4,000,000.000	3,203,853.680	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	6,000,000.000	5,874,928.860	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	4,000,000.000	3,818,311.640	
	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	6,000,000.000	5,736,418.920	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	3,000,000.000	2,554,767.600	
	UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	5,000,000.000	4,996,258.750	
	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	5,000,000.000	5,208,662.600	
	アメリカ・ドル 小計	742,080,000.000 (108,083,952,000)	650,254,205.950 (94,709,525,097)	
国債証券 合計		108,083,952,000 (108,083,952,000)	94,709,525,097 (94,709,525,097)	
合計			94,709,525,097 (94,709,525,097)	

(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	有価証券の合計金額に
----	-----	------	------------

		時価比率 (%)	対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 127銘柄	97.21	100.00

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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)

2024年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,654,200,712
コール・ローン	190,475,674
株式	79,807,323,477
投資信託受益証券	694,439,423
投資証券	60,138,506
派生商品評価勘定	31,803,710
未収配当金	135,346,691
差入委託証拠金	1,554,248,663
流動資産合計	86,127,976,856
資産合計	86,127,976,856
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	58,363,882
未払金	1,522
未払解約金	2,084,506,000
流動負債合計	2,142,871,404
負債合計	2,142,871,404
純資産の部	
元本等	
元本	54,509,988,915
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	29,475,116,537
元本等合計	83,985,105,452
純資産合計	83,985,105,452
負債純資産合計	86,127,976,856

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7月12日 至 2024年1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	2024年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	74,784,040,602円
同期中追加設定元本額	10,274,316,100円
同期中一部解約元本額	30,548,367,787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>	9,894,562,328円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>	3,636,883,728円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,658,232円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	10,819,533円

MI TO ラップ型ファンド (積極型)	27,585,447円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	36,923,480円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	33,473,924円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	23,662,721円
たわらノーロード 新興国株式	12,687,592,462円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,925,520,523円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	4,569,347,145円
たわらノーロード バランス (堅実型)	33,307,369円
たわらノーロード バランス (標準型)	143,342,253円
たわらノーロード バランス (積極型)	261,784,782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)	491,029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)	101,666,257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)	120,005,558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)	206,546,002円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	11,703円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,803,754円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,849,911円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	9,030,615円
たわらノーロード 全世界株式	886,364,229円
One DC 新興国株式インデックスファンド	1,116,808,603円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	366,664,055円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	400,914,931円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	597,969,327円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	1,151,401,895円
投資のソムリエ	6,861,428,871円
クルーズコントロール	481,958,411円
投資のソムリエ<DC年金>	660,383,026円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	449,449,869円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	743,438,141円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,475,461,283円
ワールドアセットバランス (基本コース)	535,942,539円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,165,334,694円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	47,305,280円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	23,800,396円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	6,355,346円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	101,984,193円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,795,315,591円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	330,131,203円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	36,543,639円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	26,045,312円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	15,752,589円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	3,796,891円
One グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	24,254,664円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	214,773,216円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	2,966,993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)	155,404,535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)	95,077,346円
計	54,509,988,915円

2. 受益権の総数

54,509,988,915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7月12日 至 2024年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2024年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)

株式	△35,729,583
投資信託受益証券	134,830,398
投資証券	10,051,941
合計	109,152,756

(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2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年1月11日現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち		
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	4,352,785,647	—	4,384,646,327	△31,860,680
インド・ルピー	2,205,214,104	—	2,219,214,424	△14,000,320
インドネシア・ルピア	700,000,000	—	708,000,000	△8,000,000
タイ・バーツ	83,700,000	—	84,600,000	△900,000
フィリピン・ペソ	103,250,000	—	103,992,500	△742,500
ブラジル・レアル	25,822,000	—	25,879,000	△57,000
マレーシア・リンギット	1,886,333	—	1,903,543	△17,210
韓国・ウォン	52,848,410	—	53,338,860	△490,450
台湾・ドル	537,040,000	—	542,430,000	△5,390,000
買建				
アメリカ・ドル	643,024,800	—	645,288,000	△2,263,200
アメリカ・ドル	2,147,571,543	—	2,155,997,518	8,425,975
アメリカ・ドル	2,147,571,543	—	2,155,997,518	8,425,975
合計	6,500,357,190	—	6,540,643,845	△23,434,705

(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	2024年1月11日現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち		
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建				
買建	3,225,561,804	—	3,222,436,337	△3,125,467

合計	3,225,561,804	—	3,222,436,337	△3,125,467
----	---------------	---	---------------	------------

(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)

	2024年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.5407円
(1万口当たり純資産額)	(15,407円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,977	14.720	264,621.440	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	5,356	147.610	790,599.160	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,989	83.310	582,253.590	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	219,522	1.250	274,402.500	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	1.463	130,207.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	51,568	1.905	98,237.040	
	EFG HOLDING S. A. E. -GDR	62,824	0.600	37,694.400	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC	7,574	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	107,951	0.000	0.000	
	SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000	
	TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000	
VTB BANK PJSC	304,000,000	0.000	0.000		

VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	27,140	16.850	457,309.000		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,410	11.660	412,880.600		
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	16,679	32.400	540,399.600		
JOYY INC-ADR	3,434	32.440	111,398.960		
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,056	22.910	115,832.960		
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000		
QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	14.640	146,400.000		
NIO INC ADR	112,414	7.410	832,987.740		
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	60,221	9.040	544,397.840		
AUTOHOME INC ADR	4,983	25.680	127,963.440		
WEIBO CORP ADR	6,261	9.550	59,792.550		
KANZHUN LTD ADR	19,195	14.890	285,813.550		
KE HOLDINGS INC ADR	54,478	14.740	803,005.720		
LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,782	58.540	338,478.280		
OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000		
LUFAX HOLDING LTD ADR	15,109	2.580	38,981.220		
PDD HOLDINGS INC ADR	48,415	149.190	7,223,033.850		
YUM CHINA HOLDINGS INC	33,384	38.390	1,281,611.760		
IQIYI INC ADR	33,439	4.410	147,465.990		
POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000		
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	33,649	19.130	643,705.370		
アメリカ・ドル 小計	307,332,967		16,289,473.560 (2,372,561,824)		
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	115,717	10.380	1,201,142.460	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	234,419	5.820	1,364,318.580	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	281,634	19.860	5,593,251.240	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	233,580	9.020	2,106,891.600	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	358,966	15.280	5,485,000.480	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	550,388	7.900	4,348,065.200	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	312,686	5.310	1,660,362.660	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	152,707	17.550	2,680,007.850	
	MULTIPLY GROUP	316,386	3.190	1,009,271.340	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	188,416	3.060	576,552.960	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	257,162	3.650	938,641.300	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		3,002,061		26,963,505.670 (1,071,260,080)	

インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	246,652	2,650.100	653,652,465.200	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	59,189	451.250	26,709,036.250	
	ASIAN PAINTS LTD	31,014	3,286.850	101,938,365.900	
	BANK OF BARODA	92,818	223.850	20,777,309.300	
	EICHER MOTORS LTD	11,150	3,842.550	42,844,432.500	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	21,160	2,068.550	43,770,518.000	
	HDFC BANK LTD	227,205	1,655.950	376,240,119.750	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,684	1,632.800	123,576,835.200	
	SHREE CEMENT LTD	788	26,842.150	21,151,614.200	
	ICICI BANK LTD	416,924	993.050	414,026,378.200	
	INDUSIND BANK LTD	21,721	1,640.150	35,625,698.150	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	42,590	430.700	18,343,513.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	143,026	621.750	88,926,415.500	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	21,636	886.300	19,175,986.800	
	TATA STEEL LTD	586,692	134.100	78,675,397.200	
	TATA MOTORS LTD	135,256	808.450	109,347,713.200	
	JSW STEEL LTD	49,199	829.800	40,825,330.200	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	8,325	1,718.400	14,305,680.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	42,645	1,113.950	47,504,397.750	
	BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,047	8,031.950	16,441,401.650	
	TATA POWER CO LTD	114,167	346.450	39,553,157.150	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,830	5,086.650	44,915,119.500	
	NESTLE INDIA LTD	27,150	2,578.100	69,995,415.000	
	GAIL INDIA LTD	176,391	160.000	28,222,560.000	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	87,140	1,820.800	158,664,512.000	
	VEDANTA LTD	67,908	267.050	18,134,831.400	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	5,274	4,306.100	22,710,371.400	
	AXIS BANK LTD	184,524	1,107.000	204,268,068.000	
	TITAN COMPANY LTD	29,402	3,714.450	109,212,258.900	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,604	212.100	53,577,308.400	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,435	2,396.250	27,401,118.750	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	292,960	185.600	54,373,376.000	
	LUPIN LTD	17,129	1,405.250	24,070,527.250	
	MPHASIS LTD	6,694	2,559.400	17,132,623.600	
	BAJAJ FINANCE LTD	22,138	7,680.550	170,032,015.900	
	INFOSYS LTD	268,711	1,519.900	408,413,848.900	
	WIPRO LTD	106,724	453.600	48,410,006.400	
	TATA ELXSI LTD	3,020	8,755.450	26,441,459.000	
	MRF LTD	144	131,828.400	18,983,289.600	
	INDIAN OIL CORP LTD	225,534	130.550	29,443,463.700	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	66,630	2,577.400	171,732,162.000	
	TRENT LTD	15,014	3,173.600	47,648,430.400	
	APOLLO HOSPITALS	8,120	5,800.900	47,103,308.000	

ENTERPRISE LTD				
CUMMINS INDIA LTD	12,335	2,046.150	25,239,260.250	
HCL TECHNOLOGIES LTD	77,040	1,492.100	114,951,384.000	
DABUR INDIA LTD	48,446	547.350	26,516,918.100	
HERO MOTOCORP LTD	8,789	4,138.050	36,369,321.450	
SRF LTD	11,697	2,294.900	26,843,445.300	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,071	2,649.800	18,736,735.800	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	8,653	5,787.200	50,076,641.600	
BHARTI AIRTEL LTD	181,756	1,062.700	193,152,101.200	
UNITED SPIRITS LTD	22,698	1,117.350	25,361,610.300	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	77,598	1,324.850	102,805,710.300	
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,597	3,902.650	37,453,732.050	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,018	10,010.200	110,292,383.600	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,151	1,123.000	24,875,573.000	
HAVELLS INDIA LTD	19,728	1,390.700	27,435,729.600	
TVS MOTOR COMPANY LTD	19,289	2,020.250	38,968,602.250	
INDRAPRASTHA GAS LTD	27,995	417.800	11,696,311.000	
JINDAL STEEL & POWER LTD	27,284	731.000	19,944,604.000	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	214,409	109.150	23,402,742.350	
SHRIRAM FINANCE LTD	22,842	2,150.000	49,110,300.000	
PETRONET LNG LTD	64,449	234.000	15,081,066.000	
CIPLA LTD/INDIA	42,634	1,329.200	56,669,112.800	
LARSEN & TOUBRO LTD	54,438	3,545.500	193,009,929.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,077	9,776.200	88,738,567.400	
ASHOK LEYLAND LTD	131,250	175.350	23,014,687.500	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	74,066	3,713.050	275,010,761.300	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,830	3,098.200	42,848,106.000	
NTPC LTD	347,936	313.350	109,025,745.600	
YES BANK LTD	977,054	25.500	24,914,877.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	52,658	526.150	27,706,006.700	
BHARAT FORGE LTD	20,684	1,283.850	26,555,153.400	
SUZLON ENERGY LTD	722,047	43.550	31,445,146.850	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,664	580.050	57,810,103.200	
ITC LTD	243,576	463.300	112,848,760.800	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,991	2,709.300	32,487,216.300	
UNITED PHOSPHORUS LTD	40,105	558.600	22,402,653.000	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,201	2,352.900	19,296,132.900	
SIEMENS INDIA LTD	7,072	4,180.750	29,566,264.000	
INFO EDGE INDIA LTD	5,742	5,243.400	30,107,602.800	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	50,735	468.450	23,766,810.750	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,516	1,141.300	37,110,510.800	
TECH MAHINDRA LTD	43,452	1,240.900	53,919,586.800	

INDIAN HOTELS CO LTD	67,997	458.400	31,169,824.800
MARICO LTD	39,330	531.300	20,896,029.000
POWER FINANCE CORP LTD	119,321	390.500	46,594,850.500
PAGE INDUSTRIES LTD	508	37,138.800	18,866,510.400
ABB LTD/INDIA	4,777	4,935.700	23,577,838.900
DLF LTD	49,742	796.050	39,597,119.100
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	369,258	239.150	88,308,050.700
PERSISTENT SYSTEMS LTD	3,889	7,381.300	28,705,875.700
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,610	1,214.350	51,743,453.500
REC LTD	107,141	420.800	45,084,932.800
BAJAJ FINSERV LTD	30,672	1,671.850	51,278,983.200
BAJAJ AUTO LTD	5,519	7,053.750	38,929,646.250
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	522.900	15,826,091.400
ADANI POWER LTD	62,307	542.300	33,789,086.100
MUTHOOT FINANCE LTD	11,379	1,475.350	16,788,007.650
COAL INDIA LTD	124,565	382.050	47,590,058.250
TATA MOTORS LTD	33,523	539.050	18,070,573.150
PI INDUSTRIES LTD	7,267	3,459.400	25,139,459.800
VARUN BEVERAGES LTD	36,637	1,268.700	46,481,361.900
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,498	3,911.900	33,243,326.200
LTIMINDTREE LTD	7,277	5,947.500	43,279,957.500
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,366	1,723.250	43,711,959.500
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	78,537	644.950	50,652,438.150
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	772.450	12,203,937.550
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	15,727	3,017.300	47,453,077.100
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,689	3,418.900	26,287,922.100
BANDHAN BANK LTD	52,105	231.050	12,038,860.250
GODREJ PROPERTIES LTD	9,790	2,210.900	21,644,711.000
POLYCAB INDIA LTD	3,386	4,911.850	16,631,524.100
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	33,265	1,216.250	40,458,556.250
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	22,115	765.450	16,927,926.750
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	18,362	941.700	17,291,495.400
ZOMATO LTD	419,610	134.650	56,500,486.500
MACROTECH DEVELOPERS LTD	21,458	1,136.950	24,396,673.100
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	62,992	734.200	46,248,726.400
APL APOLLO TUBES LTD	12,592	1,565.950	19,718,442.400
SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	32,684	614.700	20,090,854.800
ONE 97 COMMUNICATIONS	17,909	685.150	12,270,351.350

	LTD				
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	264,027	240.950	63,617,305.650	
	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	10,849	1,810.950	19,646,996.550	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	22,656	592.650	13,427,078.400	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	13,233	3,822.000	50,576,526.000	
	IDFC BANK LTD	285,952	83.900	23,991,372.800	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	18,897	1,388.050	26,229,980.850	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,024	541.250	17,874,240.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	10,946	3,082.150	33,737,213.900	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	35,977	1,451.450	52,218,816.650	
インド・ルピー	小計	10,824,367		7,981,674,256.550 (14,127,563,434)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	547,000	1,655.000	905,285,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,178,385	1,115.000	2,428,899,275.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	112,201	23,300.000	2,614,283,300.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	6,350.000	2,311,400,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	3,410.000	2,017,356,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,604,200	5,525.000	8,863,205,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,988,600	4,000.000	15,954,400,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	637,600	4,770.000	3,041,352,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	192,100	8,000.000	1,536,800,000.000	
	BANK MANDIRI	3,038,000	6,425.000	19,519,150,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,597,200	5,700.000	31,904,040,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,192,000	5,600.000	6,675,200,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,785,000	1,580.000	2,820,300,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	234,932	6,325.000	1,485,944,900.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,499,300	9,550.000	42,968,315,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,250,300	2,460.000	3,075,738,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	11,350.000	2,203,035,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,482,800	2,750.000	4,077,700,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,523,700	955.000	1,455,133,500.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	66,987,200	87.000	5,827,886,400.000	
	AMMAN MINERAL	528,400	6,900.000	3,645,960,000.000	

	INTERNASIONAL PT				
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	794,082	2,470.000	1,961,382,540.000	
インドネシア・ルピア 小計		99,322,700		167,292,765,915.000 (1,572,552,000)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	39.230	511,245.360	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	52.810	306,298.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	9.780	222,006.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	20.430	121,354.200	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	50.550	151,650.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	15,000	13.000	195,000.000	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	7,140	14.130	100,888.200	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	7.670	92,040.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	42.870	222,066.600	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	11.520	140,544.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	13.760	240,800.000	
	UNISPLENDOUR CORP LTD	7,040	17.040	119,961.600	
	JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	12.920	135,660.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	12.550	239,705.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	49.710	59,652.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	13.480	218,376.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	2,200	26.700	58,740.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	137.950	289,695.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	25.920	305,856.000	
	NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	12.880	114,632.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	22.490	182,169.000		
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	13,600	14.130	192,168.000		
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	15.750	218,925.000		

YINTAI GOLD CO LTD	23,900	14.460	345,594.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	6.180	194,670.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	3.400	210,120.000	
GEM CO LTD	29,100	5.180	150,738.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	66.600	173,160.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	21.660	149,454.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	4.770	277,137.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	14.780	249,782.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	5,900	85.440	504,096.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	6.720	104,784.960	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	21.220	125,282.880	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	17.200	99,966.400	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	6.970	206,312.000	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	22.160	296,057.600	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	16.010	105,666.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	25.800	131,580.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	41.130	382,509.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	20.130	209,352.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	34.140	34,140.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	36.730	881,520.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	14,350	52.320	750,792.000	
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	5,700	19.270	109,839.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	10.640	191,520.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	11.560	208,080.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	55.440	559,944.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	9.000	100,800.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	8.450	209,560.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.580	96,758.000	

NAVINFO CO LTD	5,600	7.920	44,352.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	16.190	228,279.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	27.110	325,320.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	20.500	159,900.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	10.040	517,562.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	49.810	298,860.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	59.210	132,571.190	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	29.660	340,200.200	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.650	135,255.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.750	137,625.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	14.940	593,551.260	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	26.430	285,444.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	3,584	22.960	82,288.640	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	500	30.610	15,305.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	14.880	102,672.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	83,200	5.480	455,936.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	49.600	243,040.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	11.730	179,469.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	35.500	220,100.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	28.330	141,650.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	17.750	282,225.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	17.980	176,204.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,700	160.510	1,235,927.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	57.270	274,896.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	5.510	82,374.500	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE	13,675	14.820	202,663.500	

ENERGY				
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	9.890	86,438.600	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	9,682	8.790	85,104.780	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	33.180	301,938.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	141.490	509,364.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.140	223,987.200	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	7.920	113,256.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	31,154	31.220	972,627.880	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	15.150	452,985.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.140	141,350.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.110	435,643.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	8.710	173,329.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	16.390	313,049.000	
IFLYTEK CO LTD	14,700	39.400	579,180.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.120	198,008.000	
GOERTEK INC	25,100	18.690	469,119.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.520	138,876.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	19.440	684,288.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	34,900	11.940	416,706.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	129,320	4.220	545,730.400	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.090	144,047.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	2.960	111,296.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	14.410	583,432.080	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.060	137,562.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	26.880	330,624.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	48.050	505,486.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	12.980	1,011,375.640	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,800	100.250	781,950.000	

WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,700	128.800	2,408,560.000	
WANDA FILM HOLDING CO LTD	21,700	12.470	270,599.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	6,700	7.390	49,513.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.720	811,332.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	8.640	396,576.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	33.670	407,407.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	8.160	345,168.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	9.090	883,548.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	24,480	19.320	472,953.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	133,800	4.230	565,974.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	9.740	536,674.000	
ZTE CORP	16,500	23.800	392,700.000	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.590	187,815.000	
WEICHAI POWER CO LTD	20,000	14.030	280,600.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	35.050	147,210.000	
GF SECURITIES CO LTD	15,300	13.820	211,446.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	7.590	160,149.000	
BYD CO LTD	8,400	190.290	1,598,436.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	5.430	163,986.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	5.680	193,688.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	22.930	221,503.800	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	47.400	247,428.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	16.480	181,280.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	9.400	402,320.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	33.800	70,980.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	23.890	229,344.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	15.030	175,851.000	
RISEN ENERGY CO LTD	1,100	16.900	18,590.000	

TITAN WIND ENERGY SUZHOU CO LTD	15,200	10.270	156,104.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	14.360	114,880.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	14.040	178,308.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,200	226.800	498,960.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	5.670	170,667.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	20.650	264,320.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.620	226,404.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	67,400	5.440	366,656.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	10.970	60,883.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	211.210	359,057.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	6.690	104,364.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	39.840	262,944.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	53.900	32,340.000	
NINESTAR CORP	1,100	19.660	21,626.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	5.260	200,932.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	6.880	174,889.600	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	47.720	76,352.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	17.180	290,342.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	26.440	282,908.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	104.840	190,808.800	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	69.730	125,514.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	5.450	82,295.000	
SF HOLDING CO LTD	24,400	39.040	952,576.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.480	129,328.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	36.750	147,000.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	57.060	142,650.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	36,190	6.110	221,120.900	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	7.850	305,365.000	

PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	4.690	342,370.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	38.800	89,240.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	21.560	562,716.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	19.360	125,084.960	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	13.750	125,125.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	13.020	322,896.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	55.750	172,825.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	9.860	221,850.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46	24.920	1,146.320	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	6.310	244,828.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	21.890	80,993.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	14.430	220,461.540	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	76.650	168,630.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	26.960	118,893.600	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	51.200	189,440.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	40.210	108,567.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	24.310	75,361.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	65.050	136,605.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	30.250	275,759.000	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	11.760	111,720.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,100	100.000	310,000.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	47.050	4,705.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	26.410	182,229.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	64.310	291,967.400	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	116.480	349,440.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	43.890	57,057.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	25.480	122,304.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	25.770	79,887.000	

SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	25.250	80,800.000
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.270	92,329.000
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	49.760	119,424.000
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	11.590	246,867.000
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	9.410	124,212.000
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	100	59.990	5,999.000
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	54.070	102,733.000
NANJING SECURITIES CO LTD	36,700	7.630	280,021.000
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	21.380	252,284.000
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	57,600	12.910	743,616.000
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	277.570	1,609,906.000
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	60,800	3.840	233,472.000
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.360	114,080.000
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	63.500	101,600.000
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	4,050	48.110	194,845.500
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	13.810	117,385.000
OVCTEK CHINA INC	4,060	20.530	83,351.800
SG MICRO CORP	3,395	73.380	249,125.100
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	20,240	150.660	3,049,358.400
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	76.580	230,965.280
WUXI APPTTEC CO LTD	13,972	67.620	944,786.640
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	51,400	5.560	285,784.000
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	26.960	277,688.000
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	84,000	4.210	353,640.000
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	3.530	291,225.000
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	38.250	279,225.000
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	119.730	306,508.800
NINGXIA BAOFENG ENERGY	25,300	14.570	368,621.000

GROUP CO LTD				
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	26.100	193,792.500	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	960	53.580	51,436.800	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	242.900	267,190.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	53.210	58,531.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,655	22.920	129,612.600	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	45.090	113,626.800	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	136.940	410,820.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	54.940	296,676.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	4.290	229,086.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	36.100	97,470.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	29.250	239,850.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	93.570	470,657.100	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	3,325	31.160	103,607.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	11.670	149,376.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.550	291,465.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	3.160	223,412.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	19.530	208,971.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	7.490	185,752.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	70.300	154,660.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	37.310	108,199.000	
CGN POWER CO LTD	13,200	3.360	44,352.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	199,300	4.740	944,682.000	
GONEO GROUP CO LTD	1,900	91.270	173,413.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	56.090	179,488.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	164.120	131,296.000	

SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	122.800	188,620.800	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	4,600	34.820	160,172.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	4.380	515,088.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	9.730	204,330.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	42.330	135,456.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	38.820	89,286.000	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	900	84.450	76,005.000	
HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	596	282.700	168,489.200	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	4,000	44.300	177,200.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	5.820	253,170.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	5,070	24.040	121,882.800	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	76.530	107,142.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	31.590	192,699.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	21.480	34,368.000	
SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD	7,600	16.200	123,120.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	34.230	205,380.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	53.810	153,896.600	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	19.790	229,009.880	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.610	235,316.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	7,077	76.800	543,513.600	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	72.990	211,671.000	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	5,320	16.880	89,801.600	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	95.850	249,210.000	
CHINA INTERNATIONAL	7,900	33.900	267,810.000	

CAPITAL CORP LTD				
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	34.000	156,400.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	2,600	136.850	355,810.000	
PIOTECH INC	592	197.730	117,056.160	
ASR MICROELECTRONICS CO LTD	4,000	58.670	234,680.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	8.490	341,298.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	118.450	331,660.000	
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP INC	5,600	34.730	194,488.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	37.000	150,220.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,100	315.410	346,951.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	128.940	412,608.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	251.100	614,441.700	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	16.120	306,280.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	840	272.070	228,538.800	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	29.070	250,002.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.050	380,480.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	16,800	14.200	238,560.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	7.410	869,193.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	4.850	1,482,645.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	3.710	1,532,601.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	4.040	791,840.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	173,000	5.500	951,500.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	25.800	356,040.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	33.850	1,147,515.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	98,300	28.050	2,757,315.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	52,800	37.820	1,996,896.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	106,900	14.610	1,561,809.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	159,500	6.570	1,047,915.000	

CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	133,400	3.760	501,584.000
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	13.220	561,850.000
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,000	1,641.500	9,849,000.000
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	194,300	5.840	1,134,712.000
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	19.460	1,161,762.000
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	38,700	22.730	879,651.000
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.200	199,160.000
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	120,200	23.340	2,805,468.000
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.370	608,762.000
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	2.950	679,385.000
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	228,800	4.750	1,086,800.000
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	8.930	495,615.000
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.870	415,009.000
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	26.570	786,472.000
BANK OF BEIJING CO LTD	66,400	4.670	310,088.000
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	124,800	3.990	497,952.000
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	133,600	6.040	806,944.000
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	22.410	519,912.000
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	13.130	542,269.000
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	8.580	506,220.000
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	23.130	270,621.000
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	9.070	505,199.000
CRRC CORP LTD	141,700	5.200	736,840.000
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	33,352	41.500	1,384,108.000
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	18.320	318,768.000
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	13.510	544,453.000
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	5.670	485,352.000
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	29.280	193,248.000
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	21.490	552,293.000
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	13.230	637,686.000
GD POWER DEVELOPMENT CO	101,300	4.280	433,564.000

LTD				
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	6.580	369,796.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	24.190	299,956.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	7.760	204,864.000	
GEMDALE CORP	39,700	4.170	165,549.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	33,300	13.070	435,231.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	16,000	73.000	1,168,000.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.140	325,818.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	12.280	1,270,980.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	7.450	410,495.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	13.360	510,352.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	21.630	902,230.560	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	6.000	178,800.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	81.700	800,660.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	8.370	258,633.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.420	315,950.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	69.700	306,680.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	2.980	74,500.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	37,200	5.510	204,972.000	
AIR CHINA LTD	44,800	7.030	314,944.000	
TBEA CO LTD	24,180	14.120	341,421.600	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	6.150	267,525.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.020	169,724.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	4.720	491,824.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	29.160	618,192.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	31.450	327,080.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	28.540	196,926.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	18.140	270,286.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.790	129,997.000	

HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	16.180	93,844.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	8.520	214,704.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	8.000	264,000.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	14.890	352,893.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	16.450	187,530.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	33.950	315,735.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	7.530	431,469.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	15,853	7.230	114,617.190	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	48,070	9.350	449,454.500	
CMOC GROUP LIMITED	53,400	5.290	282,486.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	37,900	9.510	360,429.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	5.530	186,914.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	51.360	462,240.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	22.570	454,108.400	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	20.880	162,864.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	9.580	265,366.000	
PEOPLE. CN CO LTD	7,000	24.530	171,710.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	84,500	2.760	233,220.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.350	362,205.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	21,000	21.670	455,070.000	
YUTONG BUS CO LTD	23,900	15.450	369,255.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	6.740	289,146.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	3.720	295,740.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	14.260	214,170.940	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.630	326,540.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	23.100	177,870.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	24.690	253,418.160	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	15.030	244,237.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	16.820	55,506.000	

CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	5.710	257,521.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.310	136,290.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	38.880	396,576.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.920	187,488.000	
YOUNGOR FASHION CO LTD	25,600	6.580	168,448.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	36.800	169,280.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.910	116,088.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	800	23.520	18,816.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	14,200	7.200	102,240.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	10.160	227,076.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	3.690	145,386.000	
HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD	300	20.740	6,222.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	5.000	98,000.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	14.620	340,646.000	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	219.020	547,550.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	6.640	226,424.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,380	213.100	1,359,578.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	11.230	141,498.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.260	355,568.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	6.190	154,750.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	1,250	28.720	35,900.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	15.990	324,597.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	2.960	86,432.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	2,700	29.690	80,163.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	8.360	266,684.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	11.250	141,750.000	
COSCO SHIPPING ENERGY	26,100	12.330	321,813.000	

TRANSPORTATION CO LTD				
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	26.500	111,300.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.420	245,944.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	7.500	355,950.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	15.960	202,692.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	13.620	79,404.600	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	9.200	179,400.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	11.990	141,482.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	9.940	222,656.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	20,900	16.500	344,850.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	24.860	422,620.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	10,654	45.160	481,134.640	
JCET GROUP CO LTD	10,900	25.610	279,149.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	20.740	141,032.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	62.760	156,900.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	29.940	158,682.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	26.760	280,712.400	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	89.700	152,490.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	9.330	188,895.180	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	2.330	145,392.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	12.520	165,264.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,924	56.200	220,528.800	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	6.570	128,772.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	10.950	214,620.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	11.630	229,111.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	14.760	231,732.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	2,210	59.900	132,379.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	34.570	169,393.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	17.830	99,848.000	
SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	91.310	191,751.000	

BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	15.200	224,960.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	33.550	140,910.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,500	46.320	69,480.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	68.480	61,632.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	1,540	87.780	135,181.200	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	24.910	64,766.000	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	1,000	174.710	174,710.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	66.760	106,816.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	133.260	186,564.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	40.600	288,260.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	27.690	307,359.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.290	651,222.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	26.910	312,156.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	67,300	6.060	407,838.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	103.000	103,000.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	840	284.990	239,391.600	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	2,320	81.860	189,915.200	
3PEAK INC	1,200	121.470	145,764.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	160	39.210	6,273.600	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,800	67.990	530,322.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	43,468	22.230	966,293.640	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	17.720	225,044.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	120.390	216,702.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.060	370,898.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	32.560	332,112.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	40,151	22.400	899,382.400	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	27,119	34.820	944,283.580	
JIANGSU KING'S LUCK	4,400	45.530	200,332.000	

BREWERY JSC LTD				
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	25.330	177,310.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	7.790	102,828.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	63.180	442,260.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	1,000	12.020	12,020.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	14.410	586,487.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	7.980	837,900.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	42.700	145,180.000	
SERES GROUP CO LTD	9,000	68.500	616,500.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	60.450	320,385.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,800	42.970	120,316.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	6.840	569,088.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	12,200	10.010	122,122.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	18.800	214,320.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	55.900	78,260.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	16.390	32,780.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	4,100	11.930	48,913.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	950	35.200	33,440.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	11.270	342,608.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	6.470	273,681.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	70.660	226,112.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	17.260	317,584.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,012	24.540	98,454.480	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,004	40.420	161,841.680	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	500	219.500	109,750.000	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	51.200	150,528.000	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	16.590	187,632.900	
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	8.180	403,274.000	
SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	51.850	342,210.000	
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	14.450	231,200.000	
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	33.860	152,370.000	

	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	103,500	2.230	230,805.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	10.750	115,025.000	
オフショア・人民元 小計		13,954,547		171,167,548.900 (3,470,713,039)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	374,259	16.350	6,119,134.650	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	257,559	5.706	1,469,631.650	
	OOREDOO QSC	60,920	10.560	643,315.200	
	QATAR FUEL QSC	46,222	16.000	739,552.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,416	17.640	660,018.240	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	69,658	10.680	743,947.440	
	INDUSTRIES QATAR QSC	122,724	12.470	1,530,368.280	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	132,031	20.180	2,664,385.580	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	190,107	3.610	686,286.270	
	MASRAF AL RAYAN	463,723	2.510	1,163,944.730	
	BARWA REAL ESTATE CO	209,228	2.866	599,647.440	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	382,470	1.795	686,533.650	
	DUKHAN BANK	131,518	3.963	521,205.830	
カタール・リアル 小計		2,477,835		18,227,970.960 (729,483,398)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	665,826	0.764	508,691.060	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	152,316	0.518	78,899.680	
	GULF BANK KSCP	146,991	0.282	41,451.460	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	606,206	0.943	571,652.250	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	125,143	0.537	67,201.790	
	MABANEE CO KPSC	61,792	0.818	50,545.850	
	BOUBYAN BANK KSCP	107,429	0.627	67,357.980	
クウェート・ディナール 小計		1,865,703		1,385,800.070 (657,672,997)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	39,057	17,400.000	679,591,800.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	34,500.000	691,690,500.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	37,131	32,060.000	1,190,419,860.000	
コロンビア・ペソ 小計		96,237		2,561,702,160.000 (94,762,486)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	21,587	38.950	840,813.650	
	JARIR MARKETING CO	45,430	15.620	709,616.600	
	CO FOR COOPERATIVE	5,690	135.400	770,426.000	

INSURANCE				
ETIHAD ETISALAT CO	30,535	51.700	1,578,659.500	
SAUDI BRITISH BANK	81,756	36.700	3,000,445.200	
AL RAJHI BANK	158,494	86.800	13,757,279.200	
ARAB NATIONAL BANK	54,333	24.920	1,353,978.360	
BANK ALBILAD	39,341	45.700	1,797,883.700	
BANK AL-JAZIRA	29,917	18.960	567,226.320	
BANQUE SAUDI FRANSI	47,778	40.800	1,949,342.400	
RIYAD BANK	118,733	28.750	3,413,573.750	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,345	16.180	668,962.100	
SAUDI TELECOM CO	162,535	41.100	6,680,188.500	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,341	133.600	2,450,357.600	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	73,081	80.000	5,846,480.000	
SAUDI ELECTRICITY CO	67,449	19.400	1,308,510.600	
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	21.700	604,279.900	
SAVOLA GROUP	20,951	43.700	915,558.700	
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	23,986	12.120	290,710.320	
ALMARAI CO JSC	19,978	62.700	1,252,620.600	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,024	198.200	599,356.800	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	31,604	32.850	1,038,191.400	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	38.800	394,363.200	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,476	10.700	647,093.200	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	46,657	14.200	662,529.400	
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	29,849	10.060	300,280.940	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	14.020	505,547.180	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,510	219.000	1,425,690.000	
ALINMA BANK	79,834	41.350	3,301,135.900	
SAUDI ARABIAN MINING CO	104,013	46.950	4,883,410.350	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,975	118.200	942,645.000	
DALLAH HEALTHCARE CO	2,553	173.200	442,179.600	
SAUDI ARABIAN OIL CO	215,578	32.900	7,092,516.200	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	7,189	292.400	2,102,063.600	
ACWA POWER CO	7,732	238.000	1,840,216.000	
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	151.600	603,519.600	

	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,248	347.800	781,854.400	
	NAHDI MEDICAL CO	3,277	139.800	458,124.600	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,500	207.200	725,200.000	
	ELM CO	1,951	887.200	1,730,927.200	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	62.900	417,341.500	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	239,164	42.900	10,260,135.600	
サウジアラビア・リアル 小計		1,999,080		90,911,234.670 (3,536,447,029)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	94,700	26.250	2,485,875.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	18.300	5,544,900.000	
	CP AXTRA PCL NVDR	159,300	28.000	4,460,400.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	129.500	5,879,300.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,317,300	1.620	3,754,026.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	650,500	6.600	4,293,300.000	
	SHIN CORP PCL	70,700	72.000	5,090,400.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	19.100	5,730,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	93,000	216.000	20,088,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	548,420	11.900	6,526,198.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	252,700	85.000	21,479,500.000	
	PTT PCL	795,100	35.250	28,027,275.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	44.500	3,582,250.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	656,100	7.950	5,215,995.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	63,750	293.000	18,678,750.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	357,600	63.000	22,528,800.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	177,700	66.000	11,728,200.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	880,200	27.750	24,425,550.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	48,200	235.000	11,327,000.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	296,710	27.750	8,233,702.500	
	THAI OIL PCL NVDR	89,000	53.250	4,739,250.000	
	CP ALL PCL NVDR	455,000	54.250	24,683,750.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	643,100	7.300	4,694,630.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	113,645	148.000	16,819,460.000		
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	135,122	26.250	3,546,952.500		
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	183,408	36.750	6,740,244.000		

	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	142,900	43.500	6,216,150.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	8.100	5,102,190.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	238,100	45.000	10,714,500.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	90,600	21.500	1,947,900.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	527,100	4.120	2,171,652.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	157,833	39.250	6,194,945.250	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	97,800	34.750	3,398,550.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	277,100	19.300	5,348,030.000	
	SCB X PCL NVDR	67,700	104.000	7,040,800.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	896,328	5.150	4,616,089.200	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	58,700	46.500	2,729,550.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	76,900	49.000	3,768,100.000	
タイ・パーツ 小計		13,071,116		339,552,164.450 (1,412,537,004)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	746.500	4,390,166.500	
	CEZ	12,777	976.500	12,476,740.500	
	MONETA MONEY BANK AS	33,423	95.100	3,178,527.300	
チェコ・コルナ 小計		52,081		20,045,434.300 (130,393,546)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	43.000	227,031,744.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	6,880	23,700.000	163,056,000.000	
	BANCO DE CHILE	3,730,618	99.380	370,748,816.840	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,704.800	144,740,929.600	
	EMPRESAS COPEC SA	29,969	6,200.000	185,807,800.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,173,923	59.710	70,094,942.330	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	99.000	166,662,639.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,823,587	9.775	135,125,562.920	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	11,218	47,290.000	530,499,220.000	
	FALABELLA SA	78,482	2,200.000	172,660,400.000	
	CENCOSUD SA	115,184	1,639.000	188,786,576.000	
	ENEL CHILE SA	2,550,215	54.000	137,711,610.000	
チリ・ペソ 小計		28,568,247		2,492,926,240.690 (395,507,734)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	260,385	40.740	10,608,084.900	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	117,614	47.480	5,584,312.720	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	107,671	45.040	4,849,501.840	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	768.000	4,370,688.000	
	HEKTAS TICARET TAS	78,592	18.430	1,448,450.560	

	KOC HOLDING AS	60,321	147.100	8,873,219.100	
	SASA POLYESTER SANAYI	105,230	35.780	3,765,129.400	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	109,000	48.460	5,282,140.000	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	9,553	221.200	2,113,123.600	
	TURK HAVA YOLLARI	44,287	249.900	11,067,321.300	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	104,797	61.500	6,445,015.500	
	TURKIYE IS BANKASI	262,880	25.700	6,756,016.000	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	81,358	139.700	11,365,712.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	281,190	23.560	6,624,836.400	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	82,771	66.000	5,462,886.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	37,811	318.250	12,033,350.750	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	78,429	19.600	1,537,208.400	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	3,431	711.000	2,439,441.000	
トルコ・リラ 小計		1,831,011		110,626,438.070 (539,137,946)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	11,459	9,095.000	104,219,605.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	36,818	2,814.000	103,605,852.000	
	OTP BANK NYRT	19,154	16,700.000	319,871,800.000	
ハンガリー・フォリント 小計		67,431		527,697,257.000 (223,165,808)	
フィリピン・ペ ソ	AYALA LAND INC	594,900	34.450	20,494,305.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	161,790	48.300	7,814,457.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	156,808	104.800	16,433,478.400	
	AYALA CORP	18,653	665.000	12,404,245.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	79,760	241.000	19,222,160.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	229,760	40.900	9,397,184.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	34,240	250.000	8,560,000.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	116,455	55.500	6,463,252.500	
	BDO UNIBANK INC	189,402	135.100	25,588,210.200	
	PLDT INC	5,690	1,288.000	7,328,720.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	820,375	33.150	27,195,431.250	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	119.800	9,038,910.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	884.000	17,134,572.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	382.000	9,328,440.000	
フィリピン・ペソ 小計		2,527,086		196,403,365.350 (508,272,269)	

ブラジル・リアル	VALE SA	275,689	72.230	19,913,016.470	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	62,900	10.190	640,951.000	
	RAIA DROGASIL SA	104,664	28.690	3,002,810.160	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	47.530	971,988.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	98,300	42.760	4,203,308.000	
	BANCO DO BRASIL SA	70,700	54.430	3,848,201.000	
	ITAUSA SA	437,907	10.150	4,444,756.050	
	GERDAU SA	93,181	21.480	2,001,527.880	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	298,710	39.030	11,658,651.300	
	VIBRA ENERGIA SA	98,600	22.680	2,236,248.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	389,112	37.750	14,688,978.000	
	CCR SA	79,920	13.820	1,104,494.400	
	WEG SA	135,644	35.320	4,790,946.080	
	BANCO BRADESCO SA PREF	438,202	16.020	7,019,996.040	
	BANCO BRADESCO SA	126,592	14.450	1,829,254.400	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	17.910	863,369.460	
	SUZANO SA	62,875	53.770	3,380,788.750	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	38.540	651,326.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	395,847	33.290	13,177,746.630	
	ENGIE BRASIL SA	15,287	44.320	677,519.840	
	LOCALIZA RENT A CAR	74,689	63.000	4,705,407.000	
	LOJAS RENNER SA	82,820	16.490	1,365,701.800	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	61,204	27.100	1,658,628.400	
	COSAN SA	98,200	19.220	1,887,404.000	
	TOTVS SA	44,400	32.440	1,440,336.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	81,000	35.430	2,869,830.000	
	JBS SA	62,900	24.280	1,527,212.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	109,262	12.010	1,312,236.620	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,198	74.760	2,033,322.480	
	ENEVA SA	68,200	12.980	885,236.000	
	HYPERA SA	29,800	35.040	1,044,192.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	462,648	13.920	6,440,060.160	
	MAGAZINE LUIZA SA	239,400	2.180	521,892.000	
	PRIO SA	63,800	44.350	2,829,530.000	
TELEFONICA BRASIL SA	33,228	50.620	1,682,001.360		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,100	33.190	1,928,339.000		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	412,761	4.450	1,836,786.450		
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA	54,800	11.470	628,556.000		

	LTDA				
	AMBEV SA	382,795	13.760	5,267,259.200	
	NATURA &CO HOLDING SA	68,800	16.760	1,153,088.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	109,000	13.580	1,480,220.000	
	TIM SA	70,700	17.290	1,222,403.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	46,300	28.430	1,316,309.000	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	267	18.310	4,888.770	
	RUMO SA	105,100	23.810	2,502,431.000	
	ブラジル・リアル 小計	6,117,058		150,649,148.200 (4,480,471,382)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	531.200	713,932.800	
	BUDIMEX SA	1,092	630.000	687,960.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,918	112.450	1,227,729.100	
	BANK PEKAO SA	14,797	147.500	2,182,557.500	
	ORLEN SA	46,737	62.560	2,923,866.720	
	LPP SA	92	15,860.000	1,459,120.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,835	478.200	1,355,697.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,671	111.200	519,415.200	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	69,851	49.520	3,459,021.520	
	CYFROWY POLSAT SA	21,710	11.800	256,178.000	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	79,636	8.698	692,673.920	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	48,154	46.250	2,227,122.500	
	DINO POLSKA SA	3,987	459.900	1,833,621.300	
	ALLEGRO. EU SA	41,696	31.450	1,311,339.200	
	PEPCO GROUP NV	16,587	24.200	401,405.400	
	ポーランド・ズロチ 小計	364,107		21,251,640.160 (783,836,995)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	168,600	4.150	699,690.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	522,200	5.950	3,107,090.000	
	CELCOMDIGI BHD	272,700	4.230	1,153,521.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	88,120	7.680	676,761.600	
	RHB BANK BHD	103,780	5.520	572,865.600	
	GAMUDA BHD	156,100	4.900	764,890.000	
	GENTING BHD	164,900	4.870	803,063.000	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	18.900	926,251.200	
	IOI CORP BHD	223,013	3.960	883,131.480	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,500	22.280	969,180.000	
	MALAYAN BANKING BHD	444,275	9.000	3,998,475.000	
	MISC BHD	102,180	7.300	745,914.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,200	120.000	744,000.000	
	PPB GROUP BHD	55,660	14.600	812,636.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	21.100	483,190.000	

	PETRONAS GAS BHD	61,000	17.520	1,068,720.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.850	684,285.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	5.700	543,210.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	213,550	10.480	2,238,004.000	
	QL RESOURCES BHD	102,850	5.880	604,758.000	
	DIALOG GROUP BHD	292,144	2.070	604,738.080	
	PUBLIC BANK BHD (LOCAL)	1,147,850	4.310	4,947,233.500	
	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.430	569,592.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	239,500	2.520	603,540.000	
	MAXIS BHD	175,800	3.860	678,588.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	3.210	712,299.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	217,400	7.000	1,521,800.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	192,300	6.060	1,165,338.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	284,100	4.900	1,392,090.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	161,500	4.350	702,525.000	
	MR DIY GROUP M BHD	245,100	1.460	357,846.000	
	マレーシア・リンギット 小計	6,547,930		35,735,225.460 (1,121,332,066)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	262,900	13.260	3,486,054.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	107,100	83.910	8,986,761.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,360	308.550	5,047,878.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	15,860	175.970	2,790,884.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	44,800	176.170	7,892,416.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	211,800	165.420	35,035,956.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	87,025	35.070	3,051,966.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,495	228.280	3,537,198.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	37.380	4,545,408.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	15,465	478.690	7,402,940.850	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	254,352	86.470	21,993,817.440	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	158,000	44.540	7,037,320.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,800	178.390	7,635,092.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	429,800	69.590	29,909,782.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	32,490	275.170	8,940,273.300	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	22,800	161.420	3,680,376.000	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	22.660	2,356,640.000	

	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,549,478	15.290	23,691,518.620	
	BANCO DEL BAJIO SA	69,500	58.240	4,047,680.000	
メキシコ・ペソ	小計	3,561,625		191,069,962.760 (1,639,131,890)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	54,745	3.448	188,760.760	
	ALPHA BANK A.E.	185,624	1.591	295,327.780	
	NATIONAL BANK OF GREECE	65,590	6.772	444,175.480	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,083	13.220	212,617.260	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	201,792	1.699	342,844.600	
	MYTILINEOS HOLDINGS	7,737	37.860	292,922.820	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,506	24.700	135,998.200	
	OPAP SA	16,204	15.850	256,833.400	
	JUMBO SA	9,500	25.140	238,830.000	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	12.300	207,562.500	
ユーロ	小計	582,786		2,615,872.800 (418,042,632)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	84,800.000	145,856,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	110,100.000	322,372,800.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,478	245,500.000	608,349,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,655	77,500.000	283,262,500.000	
	COWAY CO LTD	4,084	54,700.000	223,394,800.000	
	KT&G CORP	7,940	90,900.000	721,746,000.000	
	KAKAO CORP	25,233	59,200.000	1,493,793,600.000	
	KUM YANG CO LTD	2,599	101,800.000	264,578,200.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	4,022	23,500.000	94,517,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	3,745	49,000.000	183,505,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	23,496	7,060.000	165,881,760.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,142	221,500.000	252,953,000.000	
	LG UPLUS CORP	17,131	10,070.000	172,509,170.000	
	DOOSAN ENERBILITY	36,105	15,190.000	548,434,950.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	54,000.000	228,150,000.000	
	LG H&H CO LTD	762	332,500.000	253,365,000.000	
	LG CHEM LTD	4,014	464,500.000	1,864,503,000.000	
	LG CHEM LTD	599	296,000.000	177,304,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	35,462	36,750.000	1,303,228,500.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	19,891	19,080.000	379,520,280.000	
	S-OIL CORP	3,289	67,000.000	220,363,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	9,175	38,550.000	353,696,250.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,664	36,850.000	208,718,400.000	
	POSCO FUTURE M CO LTD	2,535	320,500.000	812,467,500.000	

LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,749	137,700.000	240,837,300.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,521	61,800.000	155,797,800.000	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,314	110,900.000	367,522,600.000	
HYUNDAI MOBIS	4,901	217,000.000	1,063,517,000.000	
SK HYNIX INC	44,244	133,500.000	5,906,574,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,695	34,700.000	197,616,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,864	109,200.000	203,548,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	11,041	186,700.000	2,061,354,700.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,036	79,100.000	161,047,600.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,149	33,100.000	236,631,900.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	11,470.000	249,873,950.000	
KIA CORPORATION	20,809	90,500.000	1,883,214,500.000	
KOREA ZINC CO LTD	676	480,500.000	324,818,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,377	18,890.000	403,811,530.000	
KOREAN AIR CO LTD	14,033	23,600.000	331,178,800.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	123,900.000	149,795,100.000	
KT CORP	5,536	33,700.000	186,563,200.000	
HLB INC	8,598	47,750.000	410,554,500.000	
LG ELECTRONICS INC	8,590	97,200.000	834,948,000.000	
LG CORP	7,447	78,800.000	586,823,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,234	9,980.000	92,155,320.000	
NAVER CORP	10,646	231,000.000	2,459,226,000.000	
L&F CO LTD	2,034	201,000.000	408,834,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	53,800.000	185,233,400.000	
KANGWON LAND INC	9,245	15,450.000	142,835,250.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,858	450,500.000	2,639,029,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12,226	25,350.000	309,929,100.000	
COSMOAM&T CO LTD	2,095	145,900.000	305,660,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,431	416,500.000	1,845,511,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,412	147,800.000	652,093,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	386,689	73,600.000	28,460,310,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	53,776	7,320.000	393,640,320.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,128	136,300.000	426,346,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	65,955	59,900.000	3,950,704,500.000	
YUHAN CORP	4,700	64,800.000	304,560,000.000	
HANON SYSTEMS	13,064	6,850.000	89,488,400.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	41,000.000	155,923,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,254	13,400.000	244,603,600.000	

CELLTRION INC	12,429	206,000.000	2,560,374,000.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,934	58,400.000	229,745,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	23,702	41,150.000	975,337,300.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,673	178,000.000	297,794,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,852	109,000.000	201,868,000.000	
POSCO DX CO LTD	4,364	59,700.000	260,530,800.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,524	64,900.000	423,407,600.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,280	131,300.000	299,364,000.000	
JYP ENTERTAINMENT CORP	2,605	100,300.000	261,281,500.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,838	128,900.000	623,618,200.000	
ECOPRO CO LTD	1,628	620,000.000	1,009,360,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	713	300,000.000	213,900,000.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,252	225,000.000	281,700,000.000	
SK INC	2,931	164,400.000	481,856,400.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	31,057	51,300.000	1,593,224,100.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,645	55,200.000	311,604,000.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,375	57,900.000	484,912,500.000	
HANMI PHARM CO LTD	585	350,000.000	204,750,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	44,900.000	248,341,900.000	
HD HYUNDAI CO LTD	3,720	62,800.000	233,616,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	116,800.000	235,118,400.000	
NETMARBLE CORP	2,112	58,500.000	123,552,000.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	49,019	12,480.000	611,757,120.000	
ECOPRO BM CO LTD	3,992	293,500.000	1,171,652,000.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,801	97,400.000	272,817,400.000	
KRAFTON INC	2,300	203,000.000	466,900,000.000	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,996	122,100.000	243,711,600.000	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,878	83,000.000	155,874,000.000	
SK SQUARE CO LTD	8,026	48,100.000	386,050,600.000	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	68,100.000	159,354,000.000	
HYBE CO LTD	1,649	250,500.000	413,074,500.000	
LG ENERGY SOLUTION	3,782	410,500.000	1,552,511,000.000	
KAKAOBANK CORP	13,292	27,050.000	359,548,600.000	
F&F CO LTD / NEW	1,268	80,300.000	101,820,400.000	
KAKAOPAY CORP	2,237	47,700.000	106,704,900.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,071	171,500.000	526,676,500.000	
SAMSUNG C&T CORP	6,453	123,800.000	798,881,400.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,418	746,000.000	1,057,828,000.000	
PEARL ABYSS CORP	2,320	37,300.000	86,536,000.000	
DOOSAN BOBCAT INC	4,542	46,000.000	208,932,000.000	
韓国・ウォン 小計	1,271,608		90,540,469,700.000	

				(10,022,829,996)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	10.900	959,200.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	7.610	776,220.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	160,000	3.030	484,800.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	8,700	113.010	983,187.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	109,000	17.120	1,866,080.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,500	28.450	1,209,125.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	350,000	4.400	1,540,000.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	482,000	3.670	1,768,940.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	181,000	15.980	2,892,380.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	54,000	27.550	1,487,700.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	234,000	4.390	1,027,260.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	713,600	6.900	4,923,840.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	324,120	12.700	4,116,324.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	266,888	25.800	6,885,710.400	
	CITIC LTD	469,000	7.460	3,498,740.000	
	LENOVO GROUP LTD	582,000	10.380	6,041,160.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,696,000	5.340	9,056,640.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	6.220	723,945.800	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,989,200	3.920	7,797,664.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	12.340	913,160.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	221,000	10.020	2,214,420.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	63,500	56.850	3,609,975.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	286,000	7.060	2,019,160.000	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	94,000	5.590	525,460.000	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	157,200	5.360	842,592.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	120,000	10.280	1,233,600.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	3.740	1,159,400.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	199,000	7.420	1,476,580.000	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	54,500	17.760	967,920.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	491,000	8.080	3,967,280.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	83,200	23.550	1,959,360.000		

BYD CO LTD	84,500	204.600	17,288,700.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	7.830	1,252,800.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	284,592	2.630	748,476.960	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	218,000	5.080	1,107,440.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	106.800	1,068,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	553,788	9.640	5,338,516.320	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.160	692,040.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	153,200	15.800	2,420,560.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	8.970	1,704,300.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	597,000	8.920	5,325,240.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	429,000	12.420	5,328,180.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	194,400	6.330	1,230,552.000	
WEICHAI POWER CO LTD	152,440	13.240	2,018,305.600	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	7.330	835,620.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	8.600	1,548,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	52,000	50.000	2,600,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	262,000	6.050	1,585,100.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	220,000	3.340	734,800.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	129,333	30.700	3,970,523.100	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	94,000	5.580	524,520.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	823,250	3.380	2,782,585.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	247,000	18.960	4,683,120.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	539,400	280.200	151,139,880.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	541,500	31.700	17,165,550.000	
LI NING CO LTD	192,000	17.740	3,406,080.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	456,000	1.920	875,520.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	438,000	2.910	1,274,580.000	
AIR CHINA / HONG KONG	156,000	4.550	709,800.000	
ZTE CORP	63,288	15.420	975,900.960	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	270,500	28.650	7,749,825.000	

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,250	7.600	1,886,700.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	686,205	4.750	3,259,473.750	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	180,250	8.890	1,602,422.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	64,500	20.650	1,331,925.000	
BAIDU INC	182,250	113.800	20,740,050.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,770,530	4.520	35,122,795.600	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	67,200	75.700	5,087,040.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	202,000	3.420	690,840.000	
MINTH GROUP LTD	66,000	14.140	933,240.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	3.170	513,540.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	342,000	3.000	1,026,000.000	
BANK OF CHINA LTD	6,396,200	2.920	18,676,904.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	77,500	7.170	555,675.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	315,970	25.800	8,152,026.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,278,235	3.680	19,423,904.800	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	95,000	8.350	793,250.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	95,500	5.930	566,315.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	147,600	3.170	467,892.000	
CHINA COAL ENERGY CO	140,000	7.460	1,044,400.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	18.120	996,600.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,600	20.100	755,760.000	
CMOC GROUP LIMITED	315,000	4.380	1,379,700.000	
CHINA CITIC BANK-H	724,800	3.740	2,710,752.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	56,900	60.950	3,468,055.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	103,400	71.300	7,372,420.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	22.850	799,750.000	
FOSUN INTERNATIONAL	212,528	4.530	962,751.840	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	316,000	3.560	1,124,960.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,200	21.750	1,657,350.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,582,000	1.130	1,787,660.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	62,500	14.420	901,250.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	351,000	3.330	1,168,830.000	

UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	141,000	5.210	734,610.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	63,500	34.500	2,190,750.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	425,000	4.700	1,997,500.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	223,000	14.660	3,269,180.000	
CRRC CORP LTD - H	385,000	3.290	1,266,650.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	121,500	4.140	503,010.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	118,000	13.280	1,567,040.000	
SINOPHARM GROUP CO	104,000	20.350	2,116,400.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	214,527	3.390	727,246.530	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	204,000	5.850	1,193,400.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	289,000	5.340	1,543,260.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	70,400	11.260	792,704.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	178,800	10.920	1,952,496.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	97,000	6.940	673,180.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	155,000	10.820	1,677,100.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	69,000	14.020	967,380.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	531,656	2.600	1,382,305.600	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.260	513,020.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,278,000	2.960	6,742,880.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	73,000	16.000	1,168,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	127,000	5.960	756,920.000	
MICROPORIT SCIENTIFIC CORP	61,200	7.310	447,372.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	146,000	16.040	2,341,840.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	239,600	3.950	946,420.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	672,000	2.430	1,632,960.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	16.580	762,680.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	287,500	3.900	1,121,250.000	

HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	667,000	3.510	2,341,170.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	102,000	17.720	1,807,440.000	
EAST BUY HOLDING LTD	32,500	29.800	968,500.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	175,000	6.100	1,067,500.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	41,400	16.440	680,616.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	14.160	906,240.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,522,000	0.790	2,782,380.000	
XIAOMI CORP	1,239,000	14.100	17,469,900.000	
BEIGENE LTD	56,400	110.400	6,226,560.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	30,612	74.050	2,266,818.600	
MEITUAN	410,510	71.750	29,454,092.500	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	112,400	15.640	1,757,936.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	14.440	1,963,840.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	4.090	1,578,740.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	99,500	41.600	4,139,200.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	500,000	0.720	360,000.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	40,300	31.750	1,279,525.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	133,000	5.930	788,690.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	88,000	13.920	1,224,960.000	
CHINA FEIHE LTD	336,000	3.890	1,307,040.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,316,768	69.300	91,252,022.400	
JD.COM INC	189,535	98.200	18,612,337.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	140,000	5.660	792,400.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	70.150	533,140.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	188,800	48.350	9,128,480.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	198,800	21.800	4,333,840.000	
BILIBILI INC	15,640	85.050	1,330,182.000	
AKESO INC	40,000	48.100	1,924,000.000	
NETEASE INC	156,800	140.100	21,967,680.000	
HORIZON CONSTRUCTION DEVELOPMENT LTD	4,703	4.530	21,304.590	
GDS HOLDINGS LTD	90,500	7.230	654,315.000	
ZAI LAB LTD	70,500	21.000	1,480,500.000	

	NONGFU SPRING CO LTD	158,200	41.150	6,509,930.000	
	LI AUTO INC	93,200	125.200	11,668,640.000	
	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	88,050	31.800	2,799,990.000	
	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	30,400	30.800	936,320.000	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	62,400	25.200	1,572,480.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	6.490	1,058,914.890	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	121,200	58.650	7,108,380.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	35,600	19.940	709,864.000	
	JD LOGISTICS INC	148,100	8.930	1,322,533.000	
	TRIP.COM GROUP LTD	44,350	296.800	13,163,080.000	
	XPENG INC	79,000	48.450	3,827,550.000	
	MINISO GROUP HOLDING LTD	28,600	42.900	1,226,940.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	42,000	17.640	740,880.000	
	CGN POWER CO LTD	826,000	2.090	1,726,340.000	
	GF SECURITIES CO LTD	83,200	8.330	693,056.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	39.250	1,899,700.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	115,800	9.710	1,124,418.000	
	3SBIO INC	127,500	6.910	881,025.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	95,500	5.220	498,510.000	
	CHINA LITERATURE LTD	38,600	26.100	1,007,460.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	25,000	13.800	345,000.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	100,000	5.720	572,000.000	
	BOC AVIATION LTD	18,100	57.450	1,039,845.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	61,200	16.560	1,013,472.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	12.240	1,199,520.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	10.100	1,240,280.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	309,500	28.000	8,666,000.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	1.670	868,400.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,040	27.700	915,208.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	15.160	909,600.000	
香港・ドル	小計	67,815,959		824,606,809.740 (15,362,424,865)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	41,505	508.000	21,084,540.000	
	ACER INC	241,110	47.200	11,380,392.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	57,738	461.000	26,617,218.000	

REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	39,334	456.000	17,936,304.000
ASIA CEMENT CORP	203,290	40.700	8,273,903.000
TAIWAN BUSINESS BANK	556,935	13.500	7,518,622.500
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	79,495	79.100	6,288,054.500
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	41,042	247.500	10,157,895.000
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,335	186.000	10,664,310.000
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	110,686	162.500	17,986,475.000
QUANTA COMPUTER INC	221,492	218.000	48,285,256.000
EVA AIRWAYS CORP	191,977	32.000	6,143,264.000
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	44,975	197.000	8,860,075.000
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	469,004	17.650	8,277,920.600
CHINA AIRLINES	231,823	20.850	4,833,509.550
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	160,684	43.950	7,062,061.800
CHINA STEEL CORP	949,704	25.850	24,549,848.400
ADVANTECH CO LTD	37,817	360.000	13,614,120.000
COMPAL ELECTRONICS INC	343,344	35.850	12,308,882.400
DELTA ELECTRONICS INC	157,087	291.000	45,712,317.000
NANYA TECHNOLOGY CORP	112,226	71.500	8,024,159.000
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	304,804	120.000	36,576,480.000
AUO CORP	526,500	18.350	9,661,275.000
TAIWAN MOBILE CO LTD	139,574	98.800	13,789,911.200
EVERGREEN MARINE CORP	83,315	148.000	12,330,620.000
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	225,768	31.200	7,043,961.600
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	169.500	6,802,204.500
ECLAT TEXTILE CO LTD	14,780	552.000	8,158,560.000
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,194	502.000	23,691,388.000
FORMOSA PLASTICS CORP	303,987	77.000	23,406,999.000
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	281,888	60.300	16,997,846.400
MEDIATEK INC	123,366	924.000	113,990,184.000
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	631,886	64.000	40,440,704.000
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	678,042	21.950	14,883,021.900
HOTAI MOTOR CO LTD	24,801	676.000	16,765,476.000
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	125,016	80.100	10,013,781.600
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	808,482	26.500	21,424,773.000

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	789,260	44.700	35,279,922.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,307,205	12.250	16,013,261.250	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,122,221	25.400	28,504,413.400	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,009,392	100.000	100,939,200.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	931,327	39.350	36,647,717.450	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,131	2,525.000	20,530,775.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	900,807	17.800	16,034,364.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,048,098	8.720	9,139,414.560	
INVENTEC CO LTD	216,699	49.050	10,629,085.950	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	165,759	107.000	17,736,213.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	842,432	19.300	16,258,937.600	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,415,862	28.050	39,714,929.100	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	850,200	26.900	22,870,380.000	
NAN YA PLASTICS CORP	380,616	64.500	24,549,732.000	
WISTRON CORP	214,789	94.500	20,297,560.500	
POU CHEN CORP	168,225	30.950	5,206,563.750	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	378,799	72.500	27,462,927.500	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,363	268.000	12,425,284.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	87,341	79.100	6,908,673.100	
E INK HOLDINGS INC	69,588	187.000	13,012,956.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	36.950	4,490,053.150	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	112,538	68.800	7,742,614.400	
TAIWAN CEMENT CORP	552,189	33.700	18,608,769.300	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,992,751	584.000	1,163,766,584.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	902,277	50.100	45,204,077.700	
WAN HAI LINES LTD	51,482	50.700	2,610,137.400	
WALSIN LIHWA CORP	237,342	36.000	8,544,312.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	247,693	28.100	6,960,173.300	
YAGEO CORP	27,060	555.000	15,018,300.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	152,894	48.800	7,461,227.200	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	30.100	4,378,496.500	
GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,790.000	12,358,160.000	
INNOLUX CORPORATION	691,396	14.600	10,094,381.600	

	WPG HOLDINGS CO LTD	133,999	82.000	10,987,918.000	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	17,565	225.500	3,960,907.500	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	4,925	2,570.000	12,657,250.000	
	PEGATRON CORP	160,827	82.900	13,332,558.300	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	6,039	3,650.000	22,042,350.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,248	966.000	10,865,568.000	
	CHAILLEASE HOLDING CO LTD	124,224	183.000	22,732,992.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,851	1,130.000	6,611,630.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	61,247	103.000	6,308,441.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	800,565	26.200	20,974,803.000	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	301,591	44.950	13,556,515.450	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	4,934	1,620.000	7,993,080.000	
	WIWYNN CORP	8,037	1,770.000	14,225,490.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	246,182	126.500	31,142,023.000	
	SILERGY CORP	26,552	451.500	11,988,228.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	275,444	29.050	8,001,648.200	
	PHARMAESSENTIA CORP	17,593	328.000	5,770,504.000	
	MOMO.COM INC	6,487	482.500	3,129,977.500	
	GLOBALWAFERS CO LTD	17,128	588.000	10,071,264.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,658	351.000	5,144,958.000	
	台湾・ドル 小計	28,147,855		2,730,454,017.210 (12,767,602,984)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	23,375	245.470	5,737,861.250	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	314.250	6,032,343.000	
	DISCOVERY LTD	43,836	137.970	6,048,052.920	
	GOLD FIELDS LTD	73,014	230.710	16,845,059.940	
	REMGRO LTD	42,134	155.850	6,566,583.900	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	43,521	106.050	4,615,402.050	
	EXXARO RESOURCES LTD	22,354	198.890	4,445,987.060	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,033	1,970.180	13,856,275.940	
	MTN GROUP LTD	135,709	111.320	15,107,125.880	
	FIRSTSTRAND LTD	407,476	71.360	29,077,487.360	
	NASPERS LTD	15,109	2,931.260	44,288,407.340	
	NEDBANK GROUP LTD	36,051	215.110	7,754,930.610	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,517	847.000	4,672,899.000	
	SASOL LTD	46,231	168.390	7,784,838.090	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,113	272.500	10,930,792.500	

STANDARD BANK GROUP LTD	108,537	206.860	22,451,963.820	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,293	70.850	5,476,209.050	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	202.360	6,104,594.120	
ABSA GROUP LTD	67,695	158.870	10,754,704.650	
SANLAM LTD	142,680	71.110	10,145,974.800	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	69,363	77.800	5,396,441.400	
KUMBA IRON ORE LTD	5,386	551.400	2,969,840.400	
OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	40.970	2,882,239.500	
VODACOM GROUP PTY LTD	51,270	106.410	5,455,640.700	
NEPI ROCKCASTLE NV	35,926	121.400	4,361,416.400	
OLD MUTUAL LTD	391,487	12.050	4,717,418.350	
REINET INVESTMENTS SCA	11,809	442.220	5,222,175.980	
PEPKOR HOLDINGS LTD	169,735	19.080	3,238,543.800	
SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	22.950	5,141,695.050	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	29,798	125.210	3,731,007.580	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	34,625	316.900	10,972,662.500	
BID CORP LTD	26,932	423.320	11,400,854.240	
南アフリカ・ランド 小計	2,507,761		304,187,429.180 (2,369,620,073)	
合計	603,909,158		79,807,323,477 (79,807,323,477)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	91,500.000	3,455,040.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	29,700.000	909,117.000	
		ENERGISA SA	19,800.000	1,077,912.000	
		KLABIN SA	59,500.000	1,323,875.000	
	ブラジル・リアル 小計		200,500.000	6,765,944.000 (201,226,617)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,226,875.000	16,341,975.000	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,100.000	6,606,799.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	158,335.000	34,543,946.950	
	メキシコ・ペソ 小計		1,428,310.000	57,492,720.950 (493,212,806)	
	投資信託受益証券 合計			1,628,810	694,439,423 (694,439,423)
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	7,010,212.000	
	メキシコ・ペソ 小計		235,400.000	7,010,212.000 (60,138,506)	
投資証券 合計			235,400	60,138,506 (60,138,506)	

合計		754, 577, 929 (754, 577, 929)	
----	--	----------------------------------	--

(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 46銘柄	2.82	—	—	2.95
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.28	—	—	1.33
インド・ルピー	株式 131銘柄	16.82	—	—	17.54
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.87	—	—	1.95
オフショア・人民元	株式 496銘柄	4.13	—	—	4.31
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.87	—	—	0.91
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.78	—	—	0.82
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.11	—	—	0.12
サウジアラビア・リアル	株式 42銘柄	4.21	—	—	4.39
タイ・バーツ	株式 38銘柄	1.68	—	—	1.75
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.16	—	—	0.16
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.47	—	—	0.49
トルコ・リラ	株式 18銘柄	0.64	—	—	0.67
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.27	—	—	0.28
フィリピン・ペソ	株式 14銘柄	0.61	—	—	0.63
ブラジル・レアル	株式 45銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	5.33 —	— 0.24	— —	5.81
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.93	—	—	0.97
マレーシア・リンギット	株式 31銘柄	1.34	—	—	1.39
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄 投資信託受益証券 3銘柄 投資証券 1銘柄	1.95 — —	— 0.59 —	— — 0.07	2.72
ユーロ	株式 11銘柄	0.50	—	—	0.52
韓国・ウォン	株式 102銘柄	11.93	—	—	12.44
香港・ドル	株式 184銘柄	18.29	—	—	19.07
台湾・ドル	株式 90銘柄	15.20	—	—	15.85
南アフリカ・ランド	株式 32銘柄	2.82	—	—	2.94

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

該当事項はありません。

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

D I A Mマネーマザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年1月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	198,833,930
国債証券	300,196,000
未収利息	3,536
前払費用	876
流動資産合計	499,034,342
資産合計	499,034,342
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	496,151,514
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	2,882,828
元本等合計	499,034,342
純資産合計	499,034,342
負債純資産合計	499,034,342

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7月12日 至 2024年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年1月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	484,219,525円
同期中追加設定元本額	11,931,989円
同期中一部解約元本額	—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
One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型)	9,943,324円
One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (隔月決算・予想分配金提示型)	1,988,665円
計	496,151,514円
2. 受益権の総数	496,151,514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7月12日 至 2024年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>
----------------------------	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年1月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△41,000
合計	△41,000

(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2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.0058円
(1万口当たり純資産額)	(10,058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

2024年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 3 5 回 利付国庫債券（2年）	100,000,000	100,041,000	
	4 4 0 回 利付国庫債券（2年）	100,000,000	100,076,000	
	4 4 1 回 利付国庫債券（2年）	100,000,000	100,079,000	
国債証券 合計		300,000,000	300,196,000	
合計			300,196,000	

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】

2024年1月31日現在

I 資産総額	9,136,107,672円
II 負債総額	24,703,443円
III 純資産総額 (I - II)	9,111,404,229円
IV 発行済数量	7,063,468,885口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2899円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年1月31日現在

I 資産総額	536,496,363,410円
II 負債総額	3,690,776,000円
III 純資産総額 (I - II)	532,805,587,410円
IV 発行済数量	431,623,425,472口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2344円

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

2024年1月31日現在

I 資産総額	556,196,061,669円
II 負債総額	15,248,996,008円
III 純資産総額 (I - II)	540,947,065,661円
IV 発行済数量	121,517,961,072口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	4.4516円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年1月31日現在

I 資産総額	257,113,373,003円
II 負債総額	2,409,560,293円
III 純資産総額 (I - II)	254,703,812,710円
IV 発行済数量	110,750,479,095口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.2998円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年1月31日現在

I 資産総額	1,314,712,361,146円
II 負債総額	1,751,962,979円
III 純資産総額 (I - II)	1,312,960,398,167円
IV 発行済数量	161,634,290,069口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	8.1230円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年1月31日現在

I 資産総額	100,017,815,635円
II 負債総額	1,596,535,088円
III 純資産総額 (I - II)	98,421,280,547円
IV 発行済数量	43,006,534,242口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.2885円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年1月31日現在

I 資産総額	84,628,695,223円
II 負債総額	49,951,535円
III 純資産総額 (I - II)	84,578,743,688円
IV 発行済数量	54,676,335,033口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.5469円

D I A Mマネーマザーファンド

2024年1月31日現在

I 資産総額	498,994,590円
II 負債総額	0円
III 純資産総額 (I - II)	498,994,590円
IV 発行済数量	496,151,514口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.0057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（2024年1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（2024年1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。

2024年1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	1,572,383,675,634
追加型株式投資信託	780	15,835,315,739,439
単位型公社債投資信託	21	36,022,651,893
単位型株式投資信託	202	1,082,536,147,383
合計	1,029	18,526,258,214,349

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第39期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年5月25日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	31,421	33,770
金銭の信託	30,332	29,184
未収委託者報酬	17,567	16,279
未収運用受託報酬	4,348	3,307
未収投資助言報酬	309	283
未収収益	5	15
前払費用	1,167	1,129
その他	2,673	2,377
流動資産計	87,826	86,346
固定資産		
有形固定資産	1,268	1,127
建物	※1 1,109	※1 1,001
器具備品	※1 158	※1 118
リース資産	-	※1 7
無形固定資産	4,561	5,021
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産	10,153	9,768
投資有価証券	241	182
関係会社株式	5,349	5,810
長期差入保証金	1,102	775
繰延税金資産	3,092	2,895
その他	367	104
固定資産計	15,983	15,918
資産合計	103,810	102,265

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		13		10
受取配当金	※1	559	※1	2,400
時効成立分配金・償還金		0		0
為替差益		7		—
雑収入		19		10
時効後支払損引当金戻入額		10		24
営業外収益計		610		2,446
営業外費用				
為替差損		—		3
金銭の信託運用損		743		1,003
早期割増退職金		20		24
雑損失		—		47
営業外費用計		764		1,079
経常利益		22,694		19,502
特別利益				
固定資産売却益		0		—
投資有価証券売却益		—		4
特別利益計		0		4
特別損失				
固定資産除却損		5		12
投資有価証券売却損		6		9
ゴルフ会員権売却損		3		—
オフィス再編費用	※2	509		—
関係会社株式評価損		—		584
特別損失計		525		606
税引前当期純利益		22,169		18,900
法人税、住民税及び事業税		6,085		4,881
法人税等調整額		584		197
法人税等合計		6,669		5,078
当期純利益		15,499		13,821

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：百万円)

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

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

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 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	—	— 1	—	— 1
資産計	—	29,186	—	29,186

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としておりません。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

(百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	239	180
関係会社株式 非上場株式	5,349	5,810

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第37期（2022年3月31日現在）

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

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

第38期（2023年3月31日現在）

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額180百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)	
	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△14	31
退職給付の支払額	△185	△191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(百万円)	
	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	△35	△44
未認識過去勤務費用	△33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	△3	△4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において20百万円、当事業年度において24百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%~3.76%	1.00%~3.56%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度97百万円、当事業年度103百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額 (一括償却資産)	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額 (税法上)	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,092	2,895
繰延税金負債	—	—
繰延税金負債合計	—	—
繰延税金資産の純額	3,092	2,895

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
法定実効税率	—	30.62 %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	—	△3.69 %
その他	—	△0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	—	26.87 %

(注) 前事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

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

のれん	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

(2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,429百万円	△8,039百万円
経常利益	△8,429百万円	△8,039百万円
税引前当期純利益	△8,429百万円	△8,039百万円
当期純利益	△7,015百万円	△6,744百万円
1株当たり当期純利益	△175,380円68銭	△168,617円97銭

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,618百万円	4,228百万円

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬(注)	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

(注) 成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(持分法損益等)

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	7,474	未払 手数料	1,579
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	13,932	未払 手数料	2,404

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19銭

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

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

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森重 俊寛

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)</p> <p>市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p>	<p>時価法</p>
<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投</p>

6. 収益及び費用の計上基準

資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

(1) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(4) 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(金融商品関係)

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

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

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

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額4,888百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額182百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

(持分法損益等)

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第39期中間会計期間
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

約 款

追加型証券投資信託
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）、「D I AM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D I AM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）、D I AM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^(*)）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^(**)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、「D I AM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ます。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

<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、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、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、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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この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満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。
- ④外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ⑤信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- ⑥ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引は約款の範囲内で行うことができます。
- ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

親投資信託
エマージング株式パッシブ・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。

（*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券及び証書等を含みます。

2. 運用方法

（1）投資対象

海外の証券取引所に上場している株式^(*)を主要投資対象とします。

（*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券及び証書等を含みます。

（2）投資態度

①主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。

②原則として、株式の組入比率は高位を維持します。

③外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

④信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

⑤ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

（3）投資制限

①株式への投資割合には、制限を設けません。

②外貨建資産への投資には、制限を設けません。

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引は約款の範囲内で行うことができます。

⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

親投資信託
D I A Mマネーマザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

（*）主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody's、S&Pとします。

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

③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。

④資金動向、市況動向に急激な変化が生じた場合、残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

①株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。

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

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

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

⑤投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑦外貨建て資産への投資は行いません。

⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。