【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年1月12日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　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
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	たわらノーロード　バランス（８資産均等型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

たわらノーロード　バランス（８資産均等型）

（以下「ファンド」または「当ファンド」という場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

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1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞

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

※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】

ありません。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

※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1月13日から2024年7月12日まで

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

※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。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金自動けいぞく投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金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、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

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

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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

*1 各マザーファンドは各資産クラスの代表的な指数(インデックス)に連動した投資成果をめざして運用を行います。
*2 当ファンドが投資するマザーファンドは下記のとおりです。(以下を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

マザーファンド	資産クラス	マザーファンドが連動対象とするインデックス
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国株式(除く日本)	MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国債券(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	新興国債券	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	国内リート	東証REIT指数(配当込み)
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国リート(除く日本)	S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)

2 各マザーファンドへの投資を通じた各資産クラスの配分比率は、均等とすることを目標とします。時価変動等により、資産配分比率が均等比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。

<配分比率>

<運用プロセス>

ポートフォリオ構築	各資産クラスの配分比率が均等となるように各マザーファンドへ資金を配分します。
▼	
リバランス	時価変動等により、資産配分比率が均等比率から一定以上乖離した場合はリバランスを行います。

*先進国株式、先進国債券、先進国リートには、日本の株式、債券、リートを含みません(以下同じ)。

3 マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。

4 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

■分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

＜商品分類＞

・商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

＜属性区分＞

・属性区分表

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

（注1）「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（注2）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

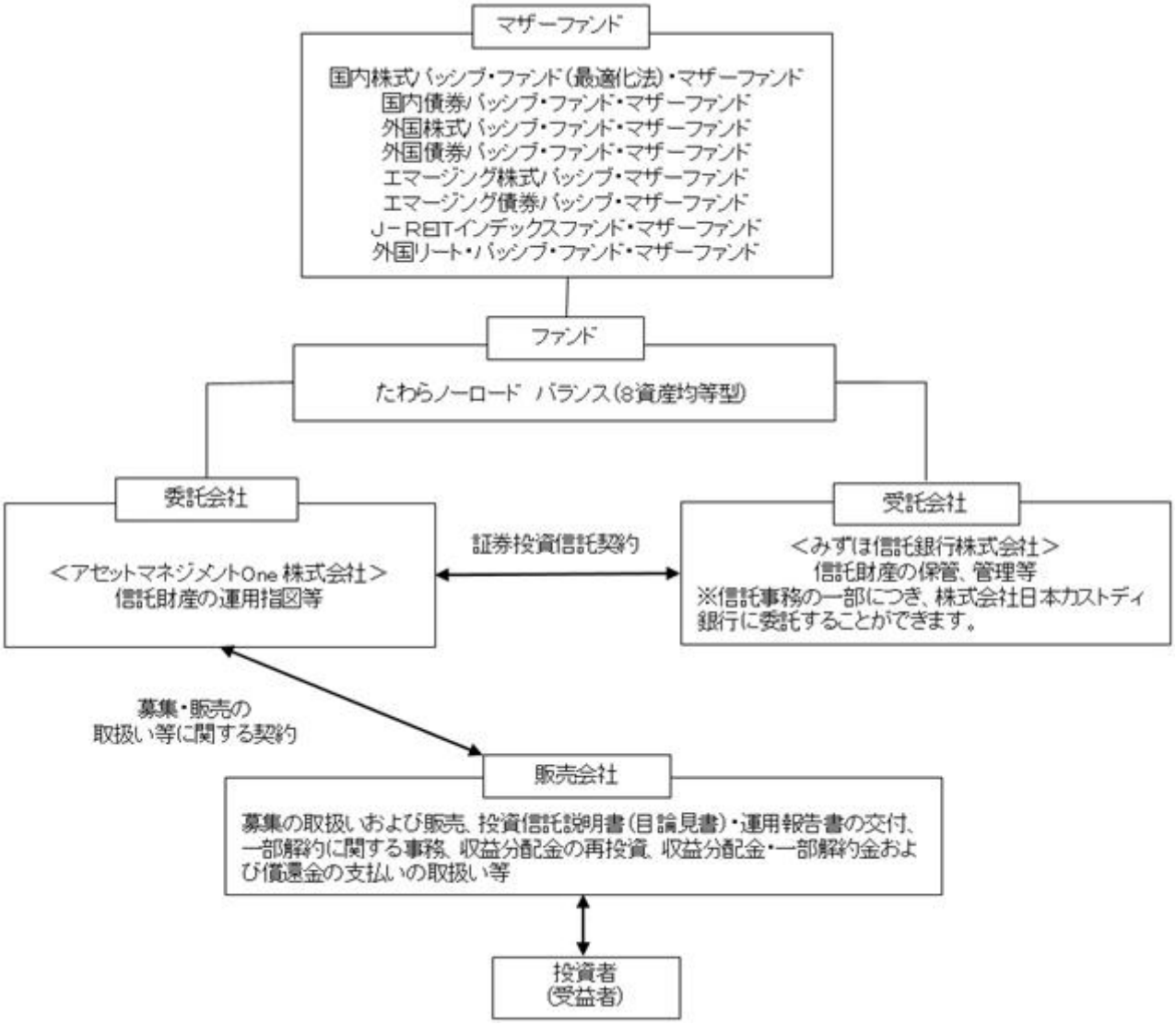
その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分固定型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、固定的とする旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、為替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ヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

（注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。
（注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式、不動産投信を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

2017年7月28日　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2019年10月1日　信託報酬率(税抜）を「年率0.22%以内」から「年率0.14%以内」に変更
2023年4月7日　信託報酬率(税抜）を「年率0.14%以内」から「年率0.13%以内」に変更

（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、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

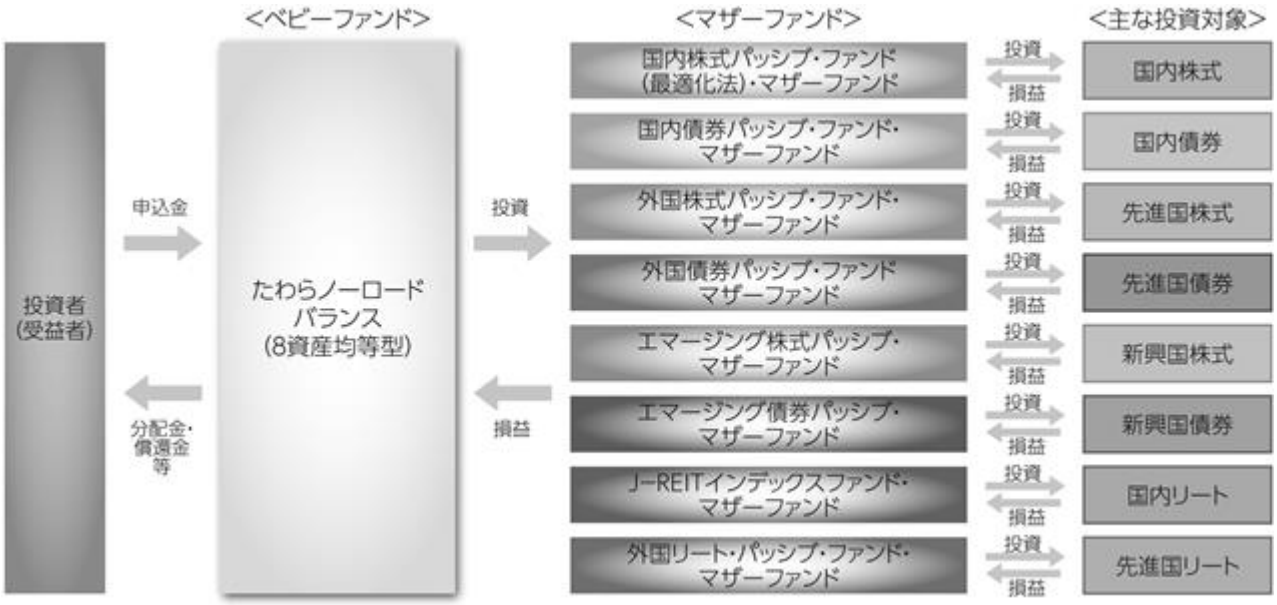
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額

20億円（2023年10月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2023年10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＞

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券（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。）を主要投資対象とします。

＜投資態度＞

① この投資信託は、主として次のマザーファンド受益証券へ均等に投資することを通じて、各資産クラスの代表的な指数に連動する投資成果をめざして運用を行い、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式（除く日本）、先進国債券（除く日本）、新興国株式、新興国債券、国内リート、先進国リート（除く日本）に投資します。

マザーファンド	資産クラス	マザーファンドが連動対象とする指数
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	国内株式	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国株式（除く日本）	ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国債券（除く日本）	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	新興国株式	ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	新興国債券	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	国内リート	東証REIT指数（配当込み）
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国リート（除く日本）	S&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）

② 各マザーファンド受益証券の配分比率は、均等とすることを目標とします。時価変動等により、配分比率が均等比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。
③ マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。
④ 実質組入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 ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1．株券または新株引受権証書
2．国債証券
3．地方債証券
4．特別の法律により法人の発行する債券
5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にして

いるもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

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、上記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ます。)

15.投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、7.で定めるものを除きます。）

16.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

17.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

18.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

19.外国法人が発行する譲渡性預金証書

20.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

21.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

22.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

23.外国の者に対する権利で上記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の指図をすることができます。

1．預金

2．指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3．コール・ローン

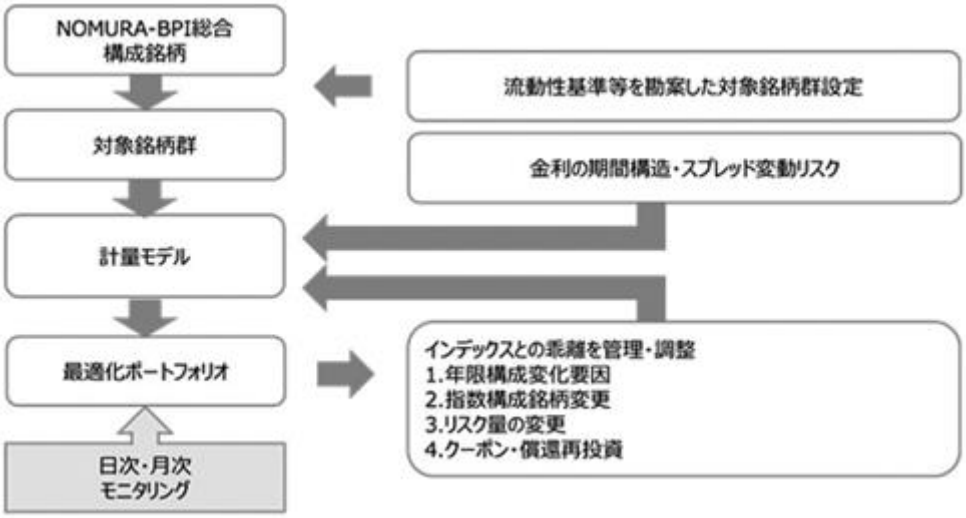
4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

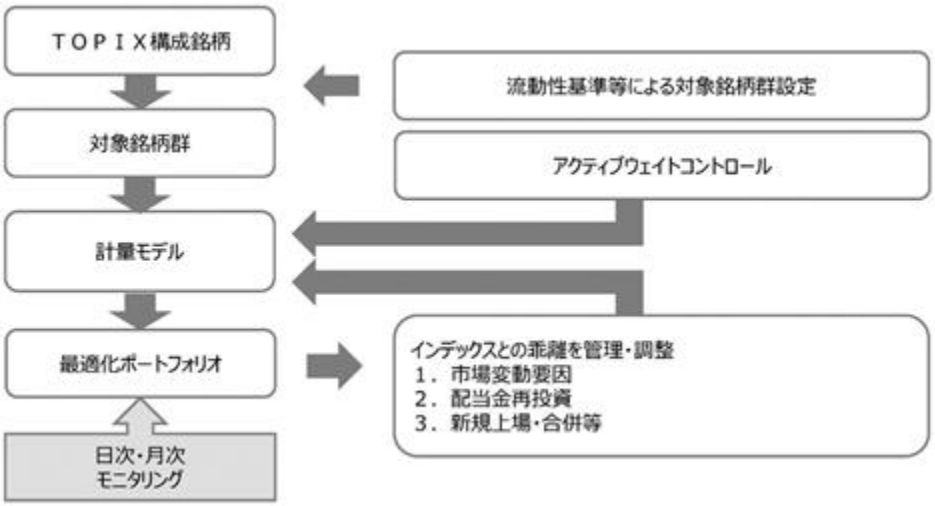
ファンド名	**国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。**
主な投資対象	**わが国の公社債を主要投資対象とします。**
投資態度	**1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。** **※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。**

運用プロセス	**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。** **2.最適化法によるポートフォリオの構築** **1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因** **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。** **3.インデックスとの乖離を管理** **日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。** **組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。** **インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。** **・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ます。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5.外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

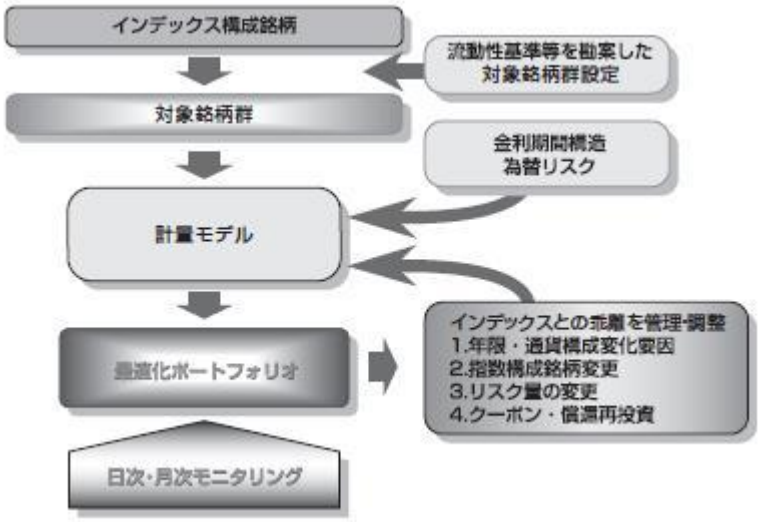
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

投資態度	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。 ※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。 ⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	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	**1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。** **※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。**

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

主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 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。

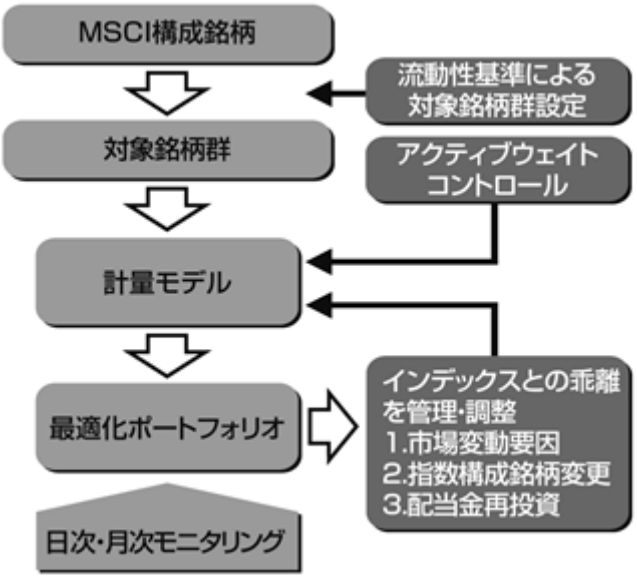
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

投資態度	**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。

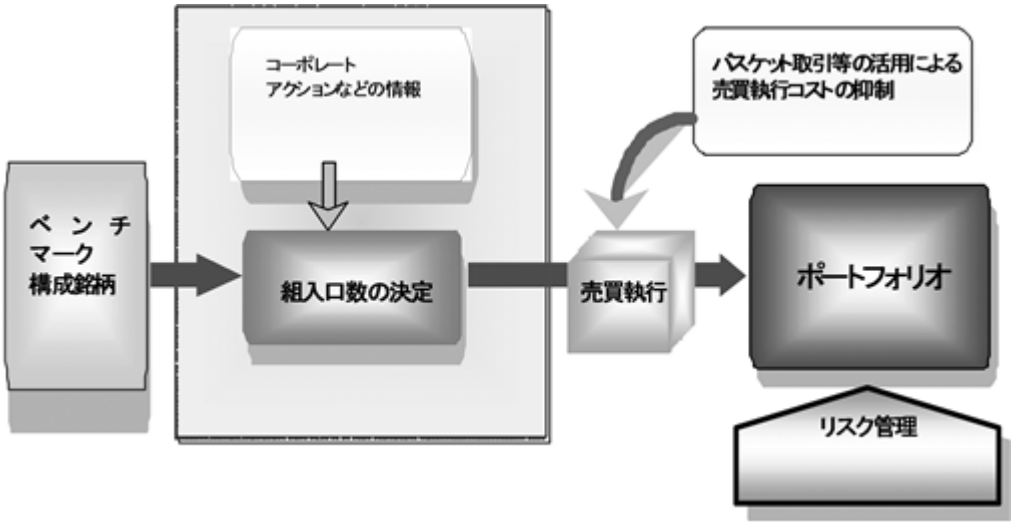
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかな

	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	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

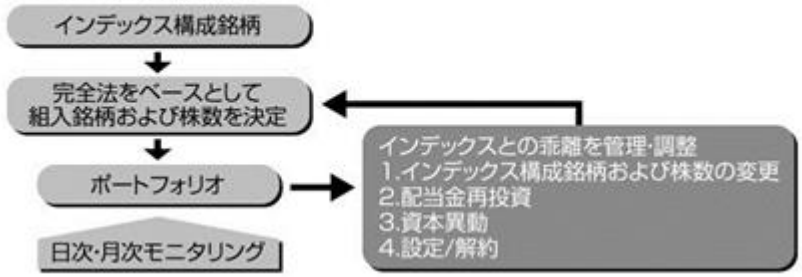
投資態度	**1.東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。** **※①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。** **②ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。** **③ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証ＲＥＩＴ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。** **④ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。** **⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。** **⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。** **⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証ＲＥＩＴ指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。** **⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。**

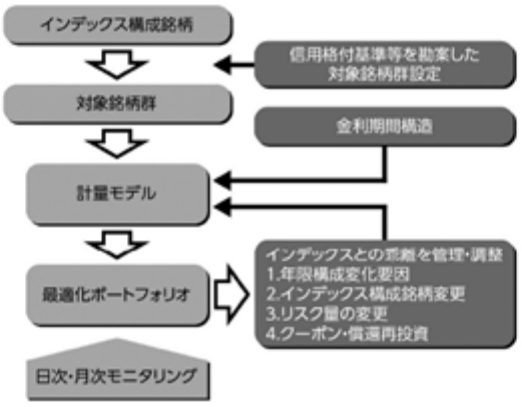
運用プロセス	・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 ③株式への投資は行いません。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

主な投資対象	**日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。** **※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。**
投資態度	**1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、Ｓ＆Ｐ先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。**

※ＳＡＰ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。
Standard & Poor’s®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび／または特定の商標、サービスマーク、および／または商標名のライセンス供与です。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。
S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはＳ＆Ｐ

	先進国 ＲＥＩＴインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。
運用プロセス	ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス（除く日本）」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。 
主な投資制限	1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3.株式への直接投資は行いません。 4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3.組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはＭｏｏｄｙ’ｓの外貨建て長期格付がＢＢ－格もしくはＢａ３格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はＪ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
運用プロセス	信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・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。

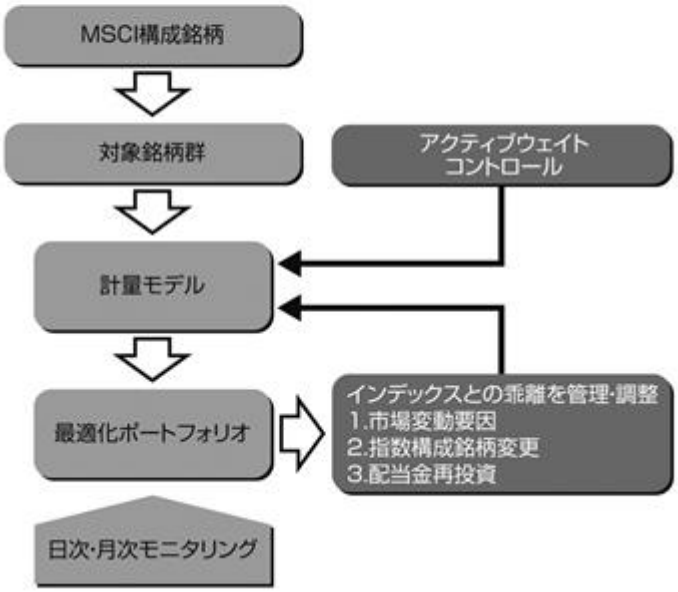
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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。

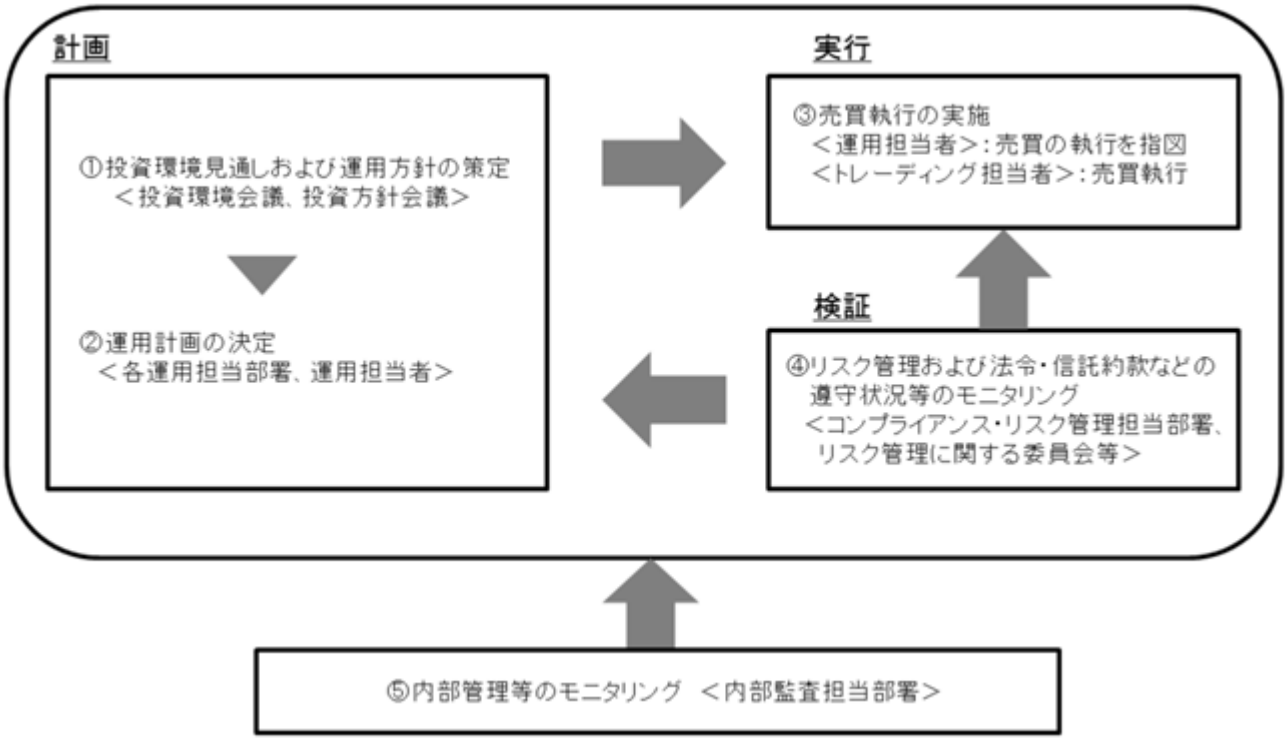
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかな

	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。**

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。

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2023年10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10月12日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

(1)分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

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

(3)留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

②収益の分配方式

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

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

2)売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配

することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

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

（５）【投資制限】

①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)

②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)

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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

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。(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ます。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

⑧信用取引の指図範囲（約款第22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書の権利行使により取得する株券
2.株式分割により取得する株券
3.有償増資により取得する株券
4.売出しにより取得する株券
5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑨先物取引等の運用指図（約款第23条）

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑩スワップ取引の運用指図（約款第24条）

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

2）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3）スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同

じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4）上記3）においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5）スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

6）委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

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

2）金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3）金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3）において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4）上記3）においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5）為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5）において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産（「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5）において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象外貨建資

産の時価総額の合計額」といいます。以下5）において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

6）上記5）においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

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

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（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、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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑭公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2)上記1)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。

3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑮公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

2)上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑯特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30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。

⑰外国為替予約取引の指図（約款第31条）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑱資金の借入れ（約款第37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。

⑲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

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

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。各資産（国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内リートおよび先進国リート）の資産配分は、均等とすることを基本とし、一定範囲内の変動に抑えます。この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

○不動産投資信託証券（リート）の価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向、関係法令・規制等の変更などの影響を受けます。また、老朽化・災害などの発生による保有不動産の滅失・損壊等が発生する可能性があります。当ファンドが実質的に投資するリートの市場価格が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。組入外貨建資産について原則として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、保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下がる可能性があります。

○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。

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下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。

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等などにより、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制などの要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。当ファンドが実質的に投資を行う新興国の通貨や株式、債券の発行者が属する国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化などが為替市場や株式、債券市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さら

に、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制などの種々な規制の導入や政策の変更等の要因も為替市場や株式、債券市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

○当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が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。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

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

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

○当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

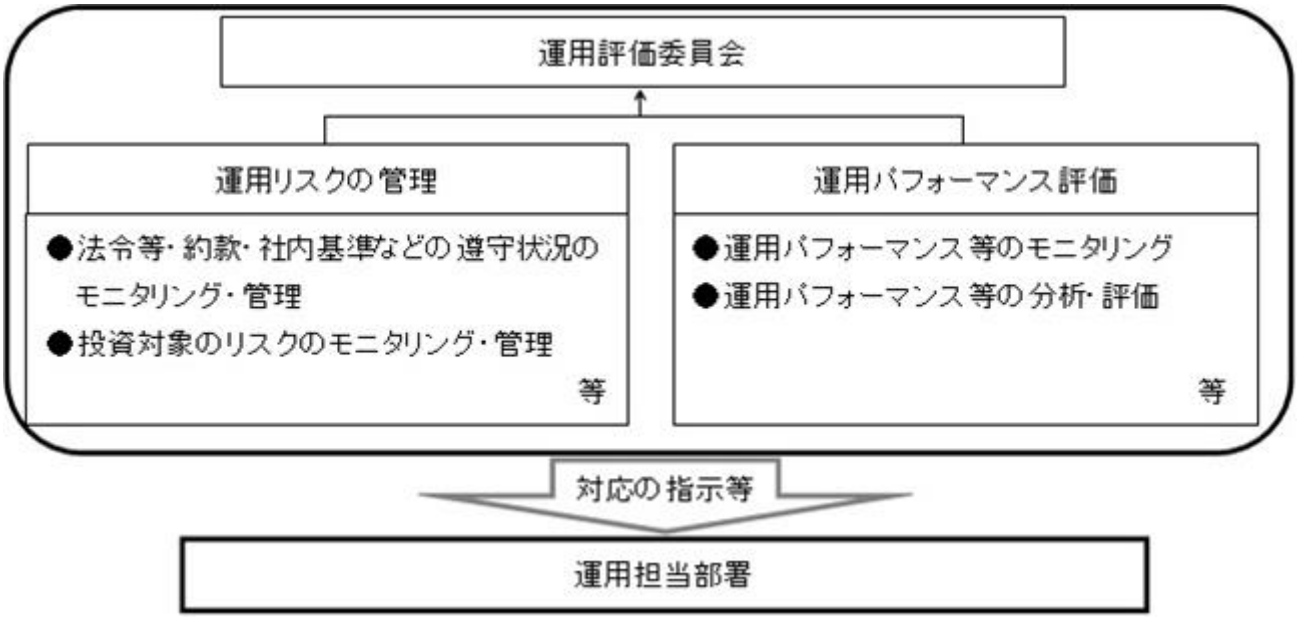
○注意事項

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

＜リスク管理体制＞

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

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



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

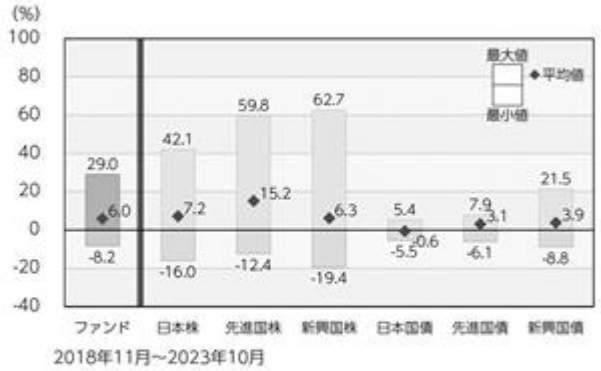
※リスク管理体制は2023年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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



2018年11月～2023年10月

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（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0.143%（税抜0.13%）以内

※2024年1月12日現在は、年率0.143%（税抜0.13%）になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.04%	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0.07%	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0.02%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

◆税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

①信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

※税法が改正された場合等は、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ます。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象とな

ります。なお、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
当ファンドは、ＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

○法人の受益者に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。
買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。
※上記は、2024年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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

＜個別元本について＞
①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合に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
0.18%	0.14%	0.04%

（表示桁数未満を四捨五入）

※対象期間:2022年10月13日～2023年10月12日
※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。
※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。
※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。
※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2023年10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		51,097,374,125	99.38
	内　日本	51,097,374,125	99.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		316,440,357	0.62
純資産総額		51,413,814,482	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		431,638,303,310	97.34
	内　日本	431,638,303,310	97.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,807,418,182	2.66
純資産総額		443,445,721,492	100.00

その他資産の投資状況

2023年10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）		12,126,520,000	2.73
	内　日本	12,126,520,000	2.73

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		457,385,896,300	84.54
	内　日本	457,385,896,300	84.54
地方債証券		29,983,125,104	5.54
	内　日本	29,983,125,104	5.54
特殊債券		28,327,893,092	5.24
	内　日本	28,327,893,092	5.24
社債券		23,993,475,960	4.43
	内　日本	23,602,862,960	4.36
	内　フランス	390,613,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,329,088,292	0.25
純資産総額		541,019,478,748	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）

株式		1,018,391,905,613	96.28
	内　アメリカ	729,396,913,856	68.96
	内　イギリス	42,982,553,444	4.06
	内　カナダ	35,329,818,296	3.34
	内　スイス	33,061,208,027	3.13
	内　フランス	32,917,655,935	3.11
	内　ドイツ	24,425,043,474	2.31
	内　オーストラリア	20,307,697,809	1.92
	内　オランダ	19,109,478,753	1.81
	内　アイルランド	18,802,575,560	1.78
	内　デンマーク	10,211,458,045	0.97
	内　スウェーデン	8,353,195,357	0.79
	内　スペイン	7,648,325,572	0.72
	内　イタリア	5,761,873,431	0.54
	内　香港	5,378,046,776	0.51
	内　ジャージィー	3,484,999,739	0.33
	内　シンガポール	3,448,384,398	0.33
	内　フィンランド	3,220,928,776	0.30
	内　ベルギー	2,257,542,070	0.21
	内　ノルウェー	2,076,093,446	0.20
	内　バミューダ	1,870,465,048	0.18
	内　イスラエル	1,869,840,310	0.18
	内　オランダ領キュラソー	1,696,684,392	0.16
	内　ケイマン諸島	1,589,648,378	0.15
	内　ニュージーランド	738,755,383	0.07
	内　オーストリア	601,799,362	0.06
	内　ポルトガル	557,128,532	0.05
	内　ルクセンブルグ	471,239,249	0.04
	内　リベリア	408,637,948	0.04
	内　パナマ	252,948,672	0.02
	内　マン島	160,965,575	0.02
新株予約権証券		0	0.00
	内　カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		1,574,093,149	0.15
	内　オーストラリア	1,109,554,766	0.10
	内　シンガポール	464,538,383	0.04
投資証券		18,397,496,009	1.74
	内　アメリカ	17,357,065,340	1.64
	内　イギリス	332,060,048	0.03
	内　フランス	327,435,512	0.03
	内　香港	243,251,951	0.02
	内　ベルギー	73,004,961	0.01
	内　カナダ	64,678,197	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		19,369,512,491	1.83
純資産総額		1,057,733,007,262	100.00

その他資産の投資状況

2023年10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）	20,074,029,746	1.90

	内　アメリカ	15,238,509,598	1.44
	内　ドイツ	2,890,133,107	0.27
	内　イギリス	880,541,204	0.08
	内　カナダ	661,418,719	0.06
	内　オーストラリア	403,427,118	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		236,117,171,552	98.68
	内　アメリカ	113,992,365,270	47.64
	内　フランス	19,815,394,112	8.28
	内　イタリア	17,611,690,738	7.36
	内　中国	16,436,234,933	6.87
	内　ドイツ	15,430,077,234	6.45
	内　スペイン	11,665,209,673	4.88
	内　イギリス	11,520,100,825	4.81
	内　カナダ	4,724,197,039	1.97
	内　ベルギー	4,292,846,033	1.79
	内　オランダ	3,443,155,421	1.44
	内　オーストラリア	3,403,593,556	1.42
	内　オーストリア	2,872,486,141	1.20
	内　メキシコ	2,099,005,451	0.88
	内　アイルランド	1,375,026,799	0.57
	内　ポーランド	1,254,584,468	0.52
	内　マレーシア	1,233,215,050	0.52
	内　フィンランド	1,215,059,789	0.51
	内　シンガポール	1,030,540,902	0.43
	内　デンマーク	735,664,736	0.31
	内　イスラエル	637,147,113	0.27
	内　ニュージーランド	522,704,583	0.22
	内　スウェーデン	453,219,226	0.19
	内　ノルウェー	353,652,460	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,153,300,061	1.32
純資産総額		239,270,471,613	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		72,896,139,048	93.90
	内　ケイマン諸島	12,684,047,196	16.34
	内　インド	11,684,054,346	15.05
	内　台湾	10,827,161,613	13.95
	内　韓国	8,728,988,365	11.24
	内　中国	8,487,675,044	10.93

	内　ブラジル	3,768,274,909	4.85
	内　サウジアラビア	3,008,356,667	3.88
	内　南アフリカ	2,076,032,124	2.67
	内　タイ	1,379,510,928	1.78
	内　インドネシア	1,373,769,039	1.77
	内　メキシコ	1,295,265,480	1.67
	内　マレーシア	1,060,116,525	1.37
	内　アラブ首長国連邦	952,057,284	1.23
	内　香港	780,457,372	1.01
	内　カタール	645,643,233	0.83
	内　ポーランド	618,491,753	0.80
	内　クエート	582,481,856	0.75
	内　トルコ	507,028,995	0.65
	内　フィリピン	446,197,424	0.57
	内　チリ	348,932,952	0.45
	内　ギリシャ	346,385,040	0.45
	内　アメリカ	325,032,443	0.42
	内　バミューダ	301,930,031	0.39
	内　ハンガリー	186,586,816	0.24
	内　チェコ	116,985,946	0.15
	内　イギリス	96,492,484	0.12
	内　コロンビア	78,201,204	0.10
	内　ルクセンブルグ	69,326,019	0.09
	内　エジプト	42,497,907	0.05
	内　オランダ	38,811,287	0.05
	内　ペルー	22,146,988	0.03
	内　シンガポール	17,199,778	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		579,486,375	0.75
	内　メキシコ	420,844,506	0.54
	内　ブラジル	158,641,869	0.20
投資証券		77,063,079	0.10
	内　メキシコ	53,957,799	0.07
	内　南アフリカ	23,105,280	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,081,889,673	5.26
純資産総額		77,634,578,175	100.00

その他資産の投資状況

2023年10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）		4,108,745,609	5.29
	内　アメリカ	4,108,745,609	5.29

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		61,599,071,784	97.68
	内　サウジアラビア	6,824,293,102	10.82
	内　メキシコ	5,987,139,308	9.49
	内　アラブ首長国連邦	5,138,107,899	8.15
	内　カタール	4,554,259,437	7.22
	内　ブラジル	4,206,425,371	6.67
	内　コロンビア	4,186,229,807	6.64
	内　チリ	4,186,069,003	6.64
	内　ドミニカ共和国	3,978,250,018	6.31
	内　ハンガリー	3,898,676,267	6.18
	内　パナマ	3,025,472,300	4.80
	内　南アフリカ	2,948,877,228	4.68
	内　インドネシア	2,711,049,786	4.30
	内　ルーマニア	2,480,790,125	3.93
	内　ペルー	2,239,252,068	3.55
	内　オマーン	2,175,434,190	3.45
	内　フィリピン	1,436,754,825	2.28
	内　中国	915,865,674	1.45
	内　ウルグアイ	706,125,376	1.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,460,112,184	2.32
純資産総額		63,059,183,968	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		175,267,199,900	97.06
	内　日本	175,267,199,900	97.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,312,245,875	2.94
純資産総額		180,579,445,775	100.00

その他資産の投資状況

2023年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		5,174,027,000	2.87
	内　日本	5,174,027,000	2.87

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		6,869,839,428	10.05
	内　オーストラリア	4,384,203,704	6.41
	内　シンガポール	2,434,969,636	3.56
	内　香港	50,666,088	0.07

投資証券		61,307,987,521	89.68
	内　アメリカ	53,406,576,517	78.12
	内　イギリス	3,077,089,115	4.50
	内　フランス	1,186,766,580	1.74
	内　カナダ	1,054,444,124	1.54
	内　香港	817,593,230	1.20
	内　ベルギー	741,374,104	1.08
	内　スペイン	280,055,423	0.41
	内　ニュージーランド	202,983,079	0.30
	内　オランダ	134,852,221	0.20
	内　ガーンジィ	134,037,637	0.20
	内　韓国	133,609,197	0.20
	内　イスラエル	79,350,478	0.12
	内　ドイツ	28,071,272	0.04
	内　アイルランド	25,053,383	0.04
	内　イタリア	6,131,161	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		183,188,423	0.27
純資産総額		68,361,015,372	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2023年10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	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,794,791,828	2.3728 6,631,731,507	2.3355 6,527,236,314	－ －	12.70
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,981,453,885	2.2009 6,562,139,593	2.1807 6,501,656,487	－ －	12.65
3	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	3,041,719,720	2.1551 6,555,288,585	2.1245 6,462,133,545	－ －	12.57
4	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,641,209,663	4.0790 6,694,532,416	3.9253 6,442,240,290	－ －	12.53
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,340,672,361	1.5220 6,606,632,980	1.4695 6,378,618,034	－ －	12.41
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	905,258,811	7.3226 6,628,927,973	6.9734 6,312,731,792	－ －	12.28
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,967,199,403	1.7118 6,791,391,956	1.5911 6,312,210,970	－ －	12.28

8	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,078,768,915	1.2329 6,261,925,459	1.2130 6,160,546,693	－ －	11.98

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.38
合計	99.38

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,394,500	1,983.87 14,669,754,177	2,590.00 19,151,755,000	－ －	4.32
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	952,600	12,116.02 11,541,722,565	12,425.00 11,836,055,000	－ －	2.67
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,306,300	968.63 8,045,773,331	1,257.00 10,441,019,100	－ －	2.35
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	134,700	60,683.53 8,174,071,686	58,150.00 7,832,805,000	－ －	1.77
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	40,174,100	157.13 6,312,591,871	176.80 7,102,780,880	－ －	1.60
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	943,000	5,801.76 5,471,068,825	7,220.00 6,808,460,000	－ －	1.54
7	三菱商事 日本	株式 卸売業	941,100	5,084.54 4,785,065,920	6,955.00 6,545,350,500	－ －	1.48
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	661,500	7,323.73 4,844,650,763	9,477.00 6,269,035,500	－ －	1.41
9	三井物産 日本	株式 卸売業	1,073,500	4,204.18 4,513,193,051	5,417.00 5,815,149,500	－ －	1.31
10	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	285,000	16,277.73 4,639,154,562	19,755.00 5,630,175,000	－ －	1.27
11	信越化学工業 日本	株式 化学	1,223,200	3,992.85 4,884,061,583	4,468.00 5,465,257,600	－ －	1.23
12	任天堂 日本	株式 その他製品	850,200	5,672.65 4,822,888,370	6,221.00 5,289,094,200	－ －	1.19

13	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	957,800	4,343.75 4,160,446,747	5,373.00 5,146,259,400	－ －	1.16
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,284,000	1,163.76 3,821,808,955	1,506.50 4,947,346,000	－ －	1.12
15	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,195,300	4,231.53 5,057,951,688	4,063.00 4,856,503,900	－ －	1.10
16	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,043,700	4,038.21 4,214,688,758	4,487.00 4,683,081,900	－ －	1.06
17	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,790,300	2,120.69 3,796,678,089	2,545.50 4,557,208,650	－ －	1.03
18	第一三共 日本	株式 医薬品	1,176,600	4,131.08 4,860,630,774	3,858.00 4,539,322,800	－ －	1.02
19	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,024,900	4,329.11 4,436,906,766	4,333.00 4,440,891,700	－ －	1.00
20	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,311,000	2,796.52 3,666,246,555	3,343.00 4,382,673,000	－ －	0.99
21	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	666,200	6,199.40 4,130,043,190	6,124.00 4,079,808,800	－ －	0.92
22	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	267,500	14,411.57 3,855,096,838	14,335.00 3,834,612,500	－ －	0.86
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,172,800	1,547.47 3,362,361,159	1,705.00 3,704,624,000	－ －	0.84
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	732,600	4,415.02 3,234,447,960	4,857.00 3,558,238,200	－ －	0.80
25	ダイキン工業 日本	株式 機械	162,400	23,068.42 3,746,311,770	21,630.00 3,512,712,000	－ －	0.79
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,225,200	2,586.60 3,169,105,299	2,477.50 3,035,433,000	－ －	0.68
27	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	805,700	2,745.95 2,212,419,868	3,521.00 2,836,869,700	－ －	0.64
28	ＳＭＣ 日本	株式 機械	40,700	68,474.11 2,786,896,626	68,680.00 2,795,276,000	－ －	0.63
29	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	491,000	5,909.15 2,901,393,474	5,493.00 2,697,063,000	－ －	0.61
30	丸紅 日本	株式 卸売業	1,187,900	1,840.75 2,186,627,940	2,178.00 2,587,246,200	－ －	0.58

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.34

合計	97.34

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年10月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	15.92
輸送用機器		8.36
情報・通信業		7.62
銀行業		7.42
卸売業		7.01
化学		5.79
機械		4.97
医薬品		4.71
サービス業		4.50
小売業		4.25
食料品		3.46
陸運業		2.81
保険業		2.46
その他製品		2.22
建設業		2.14
精密機器		2.12
不動産業		1.92
電気・ガス業		1.40
その他金融業		1.17
鉄鋼		0.96
証券、商品先物取引業		0.77
海運業		0.73
ゴム製品		0.68
ガラス・土石製品		0.67
非鉄金属		0.65
金属製品		0.50
石油・石炭製品		0.45
空運業		0.45
繊維製品		0.40
鉱業		0.39
パルプ・紙		0.19
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業		0.08
合計		97.34

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10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	１４５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	7,250,000,000	100.29 7,271,305,000	99.99 7,249,275,000	0.1 2025/9/20	1.34

2	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,540,000,000	100.97 6,603,582,400	100.55 6,576,231,600	0.4 2025/9/20	1.22
3	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	6,060,000,000	99.65 6,039,349,000	98.75 5,984,250,000	0.1 2028/3/20	1.11
4	３６３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,770,000,000	97.40 5,620,264,000	95.16 5,491,251,300	0.1 2031/6/20	1.01
5	３６６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,780,000,000	97.91 5,659,198,000	94.87 5,483,890,600	0.2 2032/3/20	1.01
6	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,390,000,000	100.02 5,391,612,000	99.29 5,352,216,100	0.1 2027/6/20	0.99
7	３６５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,630,000,000	97.01 5,461,703,000	94.43 5,316,803,100	0.1 2031/12/20	0.98
8	３５５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,430,000,000	98.94 5,372,893,000	97.70 5,305,164,300	0.1 2029/6/20	0.98
9	３６４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,550,000,000	97.29 5,399,595,000	94.80 5,261,844,000	0.1 2031/9/20	0.97
10	１４６回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,200,000,000	100.22 5,211,927,000	99.92 5,196,100,000	0.1 2025/12/20	0.96
11	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,190,000,000	100.15 5,198,254,000	99.57 5,168,150,100	0.1 2026/12/20	0.96
12	３６９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,320,000,000	100.39 5,340,964,000	96.54 5,136,034,400	0.5 2032/12/20	0.95
13	３６７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,400,000,000	98.14 5,299,664,000	94.54 5,105,376,000	0.2 2032/6/20	0.94
14	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,050,000,000	99.80 5,040,305,000	98.96 4,997,530,500	0.1 2027/12/20	0.92
15	３５１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,990,000,000	99.52 4,966,321,000	98.52 4,916,297,700	0.1 2028/6/20	0.91
16	３７０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,100,000,000	100.28 5,114,280,000	96.28 4,910,739,000	0.5 2033/3/20	0.91
17	３５３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,990,000,000	99.58 4,969,359,000	98.12 4,896,188,000	0.1 2028/12/20	0.90
18	３６８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,150,000,000	98.59 5,077,385,000	94.24 4,853,411,500	0.2 2032/9/20	0.90

19	３４６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,840,000,000	100.07 4,843,484,000	99.44 4,813,234,800	0.1 2027/3/20	0.89
20	３６２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,910,000,000	97.58 4,791,178,000	95.55 4,691,701,400	0.1 2031/3/20	0.87
21	３６０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,800,000,000	98.44 4,725,587,000	96.28 4,621,440,000	0.1 2030/9/20	0.85
22	３５２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,650,000,000	99.49 4,626,285,000	98.30 4,571,089,500	0.1 2028/9/20	0.84
23	１４４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,530,000,000	100.32 4,544,681,000	100.05 4,532,582,100	0.1 2025/6/20	0.84
24	３５８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,650,000,000	98.92 4,600,214,000	96.95 4,508,500,500	0.1 2030/3/20	0.83
25	３６１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,700,000,000	97.81 4,597,298,000	95.92 4,508,381,000	0.1 2030/12/20	0.83
26	３５９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,550,000,000	98.38 4,476,720,000	96.62 4,396,437,500	0.1 2030/6/20	0.81
27	３７１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,600,000,000	97.41 4,480,882,000	95.14 4,376,716,000	0.4 2033/6/20	0.81
28	１５４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,400,000,000	100.01 4,400,440,000	99.13 4,361,984,000	0.1 2027/9/20	0.81
29	１４８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,210,000,000	99.95 4,207,949,000	99.52 4,190,128,800	0.005 2026/6/20	0.77
30	３５４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,260,000,000	99.42 4,235,451,000	97.92 4,171,775,400	0.1 2029/3/20	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

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	84.54
地方債証券	5.54
特殊債券	5.24
社債券	4.43
合計	99.75

（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

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	2,215,083	23,748.13 52,604,083,986	25,460.05 56,396,141,433	－ －	5.33
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	994,797	42,337.28 42,117,001,155	50,431.21 50,168,824,472	－ －	4.74
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	1,300,584	15,764.55 20,503,128,881	19,841.47 25,805,501,149	－ －	2.44
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	347,940	41,021.12 14,272,889,938	61,539.81 21,412,161,874	－ －	2.02
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	837,859	15,341.28 12,853,830,367	18,608.01 15,590,892,504	－ －	1.47
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	311,606	30,593.84 9,533,226,781	45,250.69 14,100,388,564	－ －	1.33
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	743,127	15,237.32 11,323,270,873	18,800.88 13,971,443,409	－ －	1.32
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	401,893	31,993.94 12,858,143,088	29,507.29 11,858,774,746	－ －	1.12
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	131,111	74,110.89 9,716,753,525	79,238.80 10,389,078,949	－ －	0.98
10	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	113,706	57,583.29 6,547,566,528	84,579.30 9,617,174,124	－ －	0.91

11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	182,004	47,293.41 8,607,589,960	50,446.16 9,181,404,560	－ －	0.87
12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	569,045	17,168.83 9,769,837,703	15,830.11 9,008,049,952	－ －	0.85
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	411,240	21,325.16 8,769,759,625	20,545.66 8,449,198,945	－ －	0.80
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	227,651	34,431.27 7,838,313,610	34,847.79 7,933,134,423	－ －	0.75
15	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	338,995	24,092.85 8,167,358,819	21,982.45 7,451,942,434	－ －	0.70
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	331,548	21,179.86 7,022,141,106	22,315.86 7,398,779,613	－ －	0.70
17	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	58,139	97,844.65 5,688,590,674	125,775.28 7,312,449,439	－ －	0.69
18	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	460,456	11,246.21 5,178,388,949	14,407.90 6,634,204,923	－ －	0.63
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	119,047	55,810.64 6,644,089,467	55,680.51 6,628,598,173	－ －	0.63
20	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	376,135	18,214.89 6,851,258,191	16,195.72 6,091,780,527	－ －	0.58
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	141,576	46,765.86 6,620,924,414	42,084.07 5,958,094,973	－ －	0.56
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	255,277	25,381.79 6,479,389,288	21,841.91 5,575,738,765	－ －	0.53
23	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	357,359	16,179.42 5,781,863,627	15,351.68 5,486,063,443	－ －	0.52
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	248,482	22,732.20 5,648,544,174	21,213.97 5,271,290,662	－ －	0.50
25	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	62,294	76,344.23 4,755,787,710	82,960.10 5,167,917,017	－ －	0.49
26	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	208,086	22,134.07 4,605,790,478	24,373.12 5,071,705,089	－ －	0.48

27	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	64,266	60,440.67 3,884,280,660	78,782.79 5,063,055,386	－ －	0.48
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	56,784	97,703.92 5,548,019,630	87,580.31 4,973,160,890	－ －	0.47
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	577,606	8,871.64 5,124,314,303	8,394.98 4,848,994,572	－ －	0.46
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	193,765	26,181.38 5,073,035,848	24,262.48 4,701,219,979	－ －	0.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.28
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.15
投資証券	1.74
合計	98.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年10月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	8.53
半導体・半導体製造装置		5.78
コンピュータ・周辺機器		5.57
医薬品		5.25
銀行		5.12
石油・ガス・消耗燃料		5.04
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.25
保険		3.23
金融サービス		3.03
資本市場		2.99
大規模小売り		2.85
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.29
ヘルスケア機器・用品		2.10
ホテル・レストラン・レジャー		2.03
バイオテクノロジー		1.89
化学		1.89
機械		1.78
生活必需品流通・小売り		1.76
自動車		1.72
航空宇宙・防衛		1.71
電力		1.68
飲料		1.67
専門小売り		1.55
食品		1.50
金属・鉱業		1.49

情報技術サービス	1.27
繊維・アパレル・贅沢品	1.23
家庭用品	1.13
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.08
陸上運輸	1.04
専門サービス	0.99
各種電気通信サービス	0.98
娯楽	0.98
コングロマリット	0.87
電気設備	0.82
総合公益事業	0.76
通信機器	0.70
メディア	0.69
パーソナルケア用品	0.62
タバコ	0.58
商業サービス・用品	0.57
建設関連製品	0.57
航空貨物・物流サービス	0.50
電子装置・機器・部品	0.49
商社・流通業	0.43
消費者金融	0.33
不動産管理・開発	0.33
建設・土木	0.32
エネルギー設備・サービス	0.32
建設資材	0.28
家庭用耐久財	0.27
無線通信サービス	0.23
容器・包装	0.22
自動車用部品	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12
ガス	0.10
紙製品・林産品	0.10
水道	0.10
運送インフラ	0.09
販売	0.09
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	96.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,593,776,600	80.76 1,287,219,053	76.76 1,223,441,439	1.25 2031/8/15	0.51

2	US T N/B 1.5 11/30/24 アメリカ	国債証券	1,196,080,000	94.46 1,129,841,089	95.94 1,147,582,687	1.5 2024/11/30	0.48
3	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,426,325,400	84.19 1,200,915,298	79.79 1,138,163,094	1.625 2031/5/15	0.48
4	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,448,751,900	81.49 1,180,636,439	77.60 1,124,310,702	1.125 2031/2/15	0.47
5	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,387,452,800	84.87 1,177,667,746	79.66 1,105,247,063	1.875 2032/2/15	0.46
6	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,417,354,800	80.44 1,140,142,926	76.59 1,085,605,192	0.875 2030/11/15	0.45
7	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,136,276,000	103.19 1,172,584,615	94.43 1,073,026,263	4.125 2032/11/15	0.45
8	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,373,996,900	82.03 1,127,191,042	76.92 1,056,904,176	1.375 2031/11/15	0.44
9	US T N/B 4.5 07/15/26 アメリカ	国債証券	1,061,521,000	99.26 1,053,679,649	98.97 1,050,615,526	4.5 2026/7/15	0.44
10	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,203,555,500	92.10 1,108,481,721	86.01 1,035,245,783	2.875 2032/5/15	0.43
11	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証券	1,009,339,650	99.64 1,005,765,466	99.96 1,008,936,075	2.26 2025/2/24	0.42
12	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,172,158,400	91.93 1,077,633,780	84.80 993,999,474	2.75 2032/8/15	0.42
13	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,076,472,000	96.98 1,044,063,165	89.75 966,133,620	3.5 2033/2/15	0.40
14	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	1,051,055,300	91.47 961,487,390	91.21 958,759,505	1.5 2026/8/15	0.40
15	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,231,962,400	79.49 979,295,623	75.69 932,489,658	0.625 2030/8/15	0.39
16	US T N/B 3.5 04/30/28 アメリカ	国債証券	971,815,000	95.27 925,896,741	94.72 920,528,979	3.5 2028/4/30	0.38
17	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	836,018,700	101.65 849,881,256	101.74 850,628,711	3.03 2026/3/11	0.36
18	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	910,515,900	92.44 841,734,524	92.80 844,965,864	1.625 2026/2/15	0.35
19	US T N/B 4.25 12/31/24 アメリカ	国債証券	822,305,000	99.03 814,394,425	98.76 812,170,732	4.25 2024/12/31	0.34
20	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証券	897,060,000	90.27 809,846,558	90.28 809,947,058	0.75 2026/4/30	0.34
21	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	805,432,650	100.15 806,717,955	99.82 804,022,981	2.3 2026/5/15	0.34
22	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	855,197,200	90.88 777,206,241	90.64 775,189,489	0.75 2026/3/31	0.32
23	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	858,187,400	90.39 775,792,148	90.02 772,569,798	1.5 2027/1/31	0.32
24	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	869,456,800	90.34 785,515,545	88.84 772,503,672	1.5 2031/5/25	0.32

25	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	852,207,000	89.75 764,858,772	90.29 769,483,000	0.375 2026/1/31	0.32
26	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証券	841,741,300	89.53 753,613,844	89.97 757,369,881	0.75 2026/5/31	0.32
27	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	819,314,800	94.50 774,293,182	92.34 756,586,010	3.125 2028/11/15	0.32
28	FRANCE OAT 0.5 05/25/26 フランス	国債証券	802,819,600	92.92 746,055,661	93.67 752,054,908	0.5 2026/5/25	0.31
29	US T N/B 2.625 05/31/27 アメリカ	国債証券	808,849,100	93.84 759,067,254	92.73 750,112,747	2.625 2027/5/31	0.31
30	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	810,752,600	90.07 730,275,675	90.34 732,493,083	0.75 2028/5/25	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

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.68
合計	98.68

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年10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	1,917,098	2,430.66 4,659,818,490	2,453.31 4,703,251,031	－ －	6.06
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	521,700	6,944.52 3,622,961,164	5,648.04 2,946,586,641	－ －	3.80
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	372,073	7,348.46 2,734,165,539	7,470.29 2,779,496,931	－ －	3.58
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小売り	1,278,168	1,762.93 2,253,326,114	1,564.97 2,000,297,131	－ －	2.58

5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	236,722	3,875.97 917,527,703	4,185.62 990,829,521	－ －	1.28
6	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・レストラン・レジャー	394,610	2,549.95 1,006,238,011	2,179.67 860,123,524	－ －	1.11
7	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小売り	46,485	10,843.66 504,067,830	15,587.91 724,604,117	－ －	0.93
8	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	403,157	1,644.05 662,812,224	1,674.06 674,912,635	－ －	0.87
9	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	258,346	2,293.51 592,520,299	2,492.46 643,917,200	－ －	0.83
10	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,501,530	101.26 759,632,879	85.65 642,563,056	－ －	0.83
11	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	217,346	2,949.28 641,016,302	2,688.03 584,232,785	－ －	0.75
12	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	42,467	10,204.20 433,341,765	13,220.09 561,417,986	－ －	0.72
13	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	264,689	2,254.68 596,790,756	2,017.61 534,040,933	－ －	0.69
14	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	150,200	2,811.15 422,236,124	3,250.40 488,210,080	－ －	0.63
15	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	118,470	3,228.51 382,482,375	3,952.05 468,200,015	－ －	0.60
16	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	71,417	5,721.52 408,614,024	6,115.17 436,727,488	－ －	0.56
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	976,653	481.72 470,477,130	435.78 425,612,436	－ －	0.55
18	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	523,000	1,022.23 534,629,293	772.44 403,990,304	－ －	0.52
19	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	152,394	3,032.39 462,118,774	2,598.14 395,941,099	－ －	0.51

20	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	373,912	800.54 299,333,929	1,038.10 388,159,879	－ －	0.50
21	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	81,500	4,523.73 368,684,604	4,707.34 383,648,536	－ －	0.49
22	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	63,913	6,247.26 399,281,200	5,971.79 381,675,653	－ －	0.49
23	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,092,235	80.28 408,843,064	71.50 364,139,614	－ －	0.47
24	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	4,326,500	84.93 367,481,352	83.19 359,921,535	－ －	0.46
25	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	175,350	2,516.11 441,201,611	2,047.75 359,073,313	－ －	0.46
26	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小売り	15,238	26,401.69 402,309,045	23,213.56 353,728,353	－ －	0.46
27	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小売り	181,985	2,806.96 510,825,127	1,936.85 352,478,739	－ －	0.45
28	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	1,190,800	237.55 282,885,844	273.79 326,039,134	－ －	0.42
29	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,220,200	59.83 372,157,601	52.19 324,679,511	－ －	0.42
30	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	286,210	899.49 257,444,132	1,129.54 323,287,281	－ －	0.42

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	93.90
投資信託受益証券	0.75
投資証券	0.10
合計	94.74

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年10月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	15.66
半導体・半導体製造装置		8.88
コンピュータ・周辺機器		5.80
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.05
石油・ガス・消耗燃料		4.93
大規模小売り		4.79
金属・鉱業		3.56
自動車		3.01
化学		2.67
保険		2.67
ホテル・レストラン・レジャー		2.40
電子装置・機器・部品		2.33
情報技術サービス		2.15
食品		1.62
不動産管理・開発		1.48
生活必需品流通・小売り		1.45
無線通信サービス		1.40
飲料		1.29
医薬品		1.26
電気設備		1.24
各種電気通信サービス		1.24
コングロマリット		1.21
娯楽		1.13
電力		1.02
金融サービス		1.01
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.93
繊維・アパレル・贅沢品		0.93
資本市場		0.90
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		0.88
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.73
建設資材		0.71
バイオテクノロジー		0.71
消費者金融		0.69
パーソナルケア用品		0.69
専門小売り		0.66
建設・土木		0.66
運送インフラ		0.63
機械		0.62
自動車用部品		0.60
タバコ		0.36
ガス		0.35
家庭用耐久財		0.32
旅客航空輸送		0.32
陸上運輸		0.31
航空宇宙・防衛		0.30
航空貨物・物流サービス		0.29
海上運輸		0.28

ソフトウェア	0.25
通信機器	0.24
各種消費者サービス	0.24
紙製品・林産品	0.19
ヘルスケア機器・用品	0.15
商社・流通業	0.14
水道	0.11
家庭用品	0.09
メディア	0.08
エネルギー設備・サービス	0.06
商業サービス・用品	0.06
建設関連製品	0.05
総合公益事業	0.04
容器・包装	0.03
レジャー用品	0.02
合計	93.90

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年10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	1,644,610,000	104.07 1,711,690,651	99.25 1,632,367,523	7.125 2033/1/17	2.59
2	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,495,100,000	94.84 1,418,030,573	90.93 1,359,640,665	5.5 2029/2/22	2.16
3	COLOMBIA 7.5 02/02/34 コロンビア	国債証券	1,345,590,000	96.01 1,291,937,983	93.19 1,254,037,361	7.5 2034/2/2	1.99
4	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	1,495,100,000	89.51 1,338,264,010	81.56 1,219,516,484	4.817 2049/3/14	1.93
5	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証券	1,196,080,000	96.35 1,152,493,648	96.73 1,157,014,831	2.125 2024/9/30	1.83
6	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証券	1,225,982,000	87.33 1,070,757,727	85.82 1,052,153,690	3.25 2030/10/22	1.67
7	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証券	1,046,570,000	95.79 1,002,591,498	95.11 995,474,935	2.875 2025/6/6	1.58
8	BRAZIL 3.75 09/12/31 ブラジル	国債証券	1,196,080,000	85.42 1,021,752,512	83.02 993,102,353	3.75 2031/9/12	1.57
9	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,046,570,000	95.11 995,434,589	94.04 984,239,430	4 2029/3/14	1.56
10	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	1,046,570,000	99.64 1,042,869,627	93.92 982,961,568	4.375 2029/4/16	1.56
11	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	1,196,080,000	85.55 1,023,254,812	76.99 920,979,207	7.3 2052/4/20	1.46

12	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証券	1,196,080,000	77.20 923,449,113	75.73 905,830,986	3 2034/1/15	1.44
13	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,046,570,000	86.24 902,621,772	85.14 891,060,163	4.85 2029/9/30	1.41
14	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	897,060,000	97.35 873,365,655	97.05 870,619,156	6 2029/8/1	1.38
15	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証券	897,060,000	97.80 877,384,484	96.88 869,071,728	3.4 2025/4/16	1.38
16	OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28 オマーン	国債証券	897,060,000	100.60 902,487,213	96.81 868,493,124	5.625 2028/1/17	1.38
17	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	897,060,000	96.56 866,201,136	95.56 857,315,756	2.5 2025/4/16	1.36
18	COLOMBIA 3.25 04/22/32 コロンビア	国債証券	1,196,080,000	72.10 862,432,969	71.51 855,400,126	3.25 2032/4/22	1.36
19	REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27 チリ	国債証券	926,962,000	93.83 869,784,301	91.46 847,851,900	2.75 2027/1/31	1.34
20	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,046,570,000	74.38 778,483,619	72.03 753,857,976	2.125 2031/9/22	1.20
21	HUNGARY 6.125 05/22/28 ハンガリー	国債証券	747,550,000	101.94 762,097,323	99.11 740,904,280	6.125 2028/5/22	1.17
22	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	747,550,000	99.46 743,543,132	97.89 731,847,712	5.5 2032/10/25	1.16
23	ROMANIA 4.0 02/14/51 ルーマニア	国債証券	1,196,080,000	69.02 825,645,800	61.05 730,275,016	4 2051/2/14	1.16
24	PANAMA 3.16 01/23/30 パナマ	国債証券	897,060,000	86.22 773,499,344	81.27 729,073,682	3.16 2030/1/23	1.16
25	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28 サウジアラビア	国債証券	747,550,000	102.07 763,042,226	96.91 724,484,344	4.75 2028/1/18	1.15
26	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証券	747,550,000	102.52 766,458,529	95.81 716,227,655	6.25 2032/9/22	1.14
27	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	747,550,000	96.78 723,511,184	94.45 706,125,376	4.375 2031/1/23	1.12
28	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証券	747,550,000	95.96 717,393,833	94.33 705,196,807	5.25 2029/6/16	1.12
29	DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49 ドミニカ共和国	国債証券	897,060,000	81.73 733,185,683	78.15 701,117,704	6.4 2049/6/5	1.11
30	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証券	897,060,000	81.92 734,949,913	77.86 698,472,840	2.659 2031/5/24	1.11

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.68
合計	97.68

（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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年10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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	19,784	567,877.07 11,234,880,073	607,000.00 12,008,888,000	－ －	6.65
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	17,420	540,024.78 9,407,231,732	561,000.00 9,772,620,000	－ －	5.41
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	54,842	165,121.30 9,055,582,433	166,900.00 9,153,129,800	－ －	5.07
4	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	29,543	303,891.36 8,977,862,664	268,800.00 7,941,158,400	－ －	4.40
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	81,290	97,869.61 7,955,821,224	97,500.00 7,925,775,000	－ －	4.39
6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	57,286	145,666.81 8,344,669,213	135,500.00 7,762,253,000	－ －	4.30
7	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	48,805	160,880.36 7,851,766,130	157,600.00 7,691,668,000	－ －	4.26
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	25,564	289,034.20 7,388,870,539	267,600.00 6,840,926,400	－ －	3.79
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	33,791	179,190.83 6,055,037,570	173,800.00 5,872,875,800	－ －	3.25
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	37,936	148,694.19 5,640,862,999	152,400.00 5,781,446,400	－ －	3.20
11	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	16,639	353,010.32 5,873,738,787	328,500.00 5,465,911,500	－ －	3.03
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	82,112	58,715.00 4,821,206,451	58,100.00 4,770,707,200	－ －	2.64
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	11,598	352,173.89 4,084,512,886	354,000.00 4,105,692,000	－ －	2.27
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	50,961	81,340.69 4,145,202,959	79,600.00 4,056,495,600	－ －	2.25

15	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	56,771	76,046.20 4,317,219,191	68,700.00 3,900,167,700	－ －	2.16
16	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	8,897	406,269.97 3,614,583,962	408,500.00 3,634,424,500	－ －	2.01
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	5,856	655,684.14 3,839,686,347	609,000.00 3,566,304,000	－ －	1.97
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	25,876	153,148.13 3,962,861,182	135,700.00 3,511,373,200	－ －	1.94
19	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,054	495,267.07 3,493,613,930	456,500.00 3,220,151,000	－ －	1.78
20	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	21,679	160,515.78 3,479,821,742	148,200.00 3,212,827,800	－ －	1.78
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	10,863	317,729.41 3,451,494,621	279,900.00 3,040,553,700	－ －	1.68
22	イオンリート投資法人 日本	投資証券	20,803	154,104.75 3,205,841,124	144,000.00 2,995,632,000	－ －	1.66
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,292	482,564.13 3,036,293,526	452,500.00 2,847,130,000	－ －	1.58
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	19,943	147,912.33 2,949,815,630	141,500.00 2,821,934,500	－ －	1.56
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	24,975	112,371.07 2,806,467,700	111,800.00 2,792,205,000	－ －	1.55
26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,339	338,774.08 2,825,037,125	321,000.00 2,676,819,000	－ －	1.48
27	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	15,867	159,494.92 2,530,706,032	154,200.00 2,446,691,400	－ －	1.35
28	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	32,689	71,125.64 2,325,026,170	73,700.00 2,409,179,300	－ －	1.33
29	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	3,513	606,929.29 2,132,142,623	661,000.00 2,322,093,000	－ －	1.29
30	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	5,856	418,620.27 2,451,440,354	380,500.00 2,228,208,000	－ －	1.23

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.06
合計	97.06

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	379,676	17,593.88 6,679,975,543	14,783.54 5,612,958,674	－ －	8.21
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	38,456	113,707.47 4,372,734,565	106,948.98 4,112,830,294	－ －	6.02
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	212,779	12,068.58 2,567,941,973	12,240.38 2,604,496,603	－ －	3.81
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	64,917	41,999.44 2,726,478,034	35,705.97 2,317,924,986	－ －	3.39
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	124,186	16,544.88 2,054,643,076	18,252.18 2,266,665,324	－ －	3.32
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	134,233	16,540.92 2,220,338,562	15,747.88 2,113,886,290	－ －	3.09
7	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	290,782	8,543.26 2,484,226,716	6,910.35 2,009,406,033	－ －	2.94
8	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	415,844	4,565.66 1,898,603,553	4,063.68 1,689,857,694	－ －	2.47
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	58,285	27,711.86 1,615,186,053	24,317.80 1,417,363,060	－ －	2.07
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	703,595	1,983.54 1,395,610,483	1,949.49 1,371,652,260	－ －	2.01
11	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	86,719	20,607.30 1,787,045,037	15,538.57 1,347,489,624	－ －	1.97
12	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	141,596	9,547.60 1,351,903,322	8,142.31 1,152,919,178	－ －	1.69
13	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	120,099	8,526.65 1,024,042,679	8,714.93 1,046,655,326	－ －	1.53
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	236,725	5,038.88 1,192,830,265	4,376.15 1,035,945,931	－ －	1.52
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	165,586	6,663.33 1,103,354,787	6,212.14 1,028,643,496	－ －	1.50
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	64,102	16,468.11 1,055,638,796	13,908.91 891,589,288	－ －	1.30
17	MID AMERICA アメリカ	投資証券	48,032	21,867.78 1,050,353,221	17,568.92 843,870,370	－ －	1.23
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	51,113	18,781.95 960,002,313	16,404.23 838,469,776	－ －	1.23
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	26,364	34,309.18 904,527,247	31,403.08 827,910,811	－ －	1.21
20	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	76,536	10,040.55 768,463,684	9,824.30 751,912,785	－ －	1.10

21	LINK REIT 香港	投資証券	1,047,920	835.21 875,242,317	695.96 729,318,786	－ －	1.07
22	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	107,915	7,170.50 773,805,359	6,603.85 712,655,195	－ －	1.04
23	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	87,911	9,669.44 850,050,838	7,886.65 693,323,507	－ －	1.01
24	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	292,435	2,471.94 722,884,249	2,299.46 672,443,696	－ －	0.98
25	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	254,801	2,792.19 711,453,195	2,583.53 658,286,740	－ －	0.96
26	SEGRO PLC イギリス	投資証券	503,399	1,330.23 669,637,911	1,260.18 634,375,948	－ －	0.93
27	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	130,705	5,215.21 681,655,080	4,814.22 629,242,886	－ －	0.92
28	UDR INC アメリカ	投資証券	124,592	6,077.93 757,262,241	4,727.50 589,009,452	－ －	0.86
29	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	67,555	8,943.38 604,170,626	8,702.97 587,929,617	－ －	0.86
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	43,893	15,985.26 701,641,266	12,548.37 550,785,793	－ －	0.81

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.05
投資証券	89.68
合計	99.73

（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）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年10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　０５１２月	買建	538	12,502,882,540	12,126,520,000	2.73

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10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 Dec23	買建	487	15,688,803,816	15,238,509,598	1.44
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec23	買建	451	2,966,578,668	2,890,133,107	0.27
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec23	買建	66	908,627,304	880,541,204	0.08
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec23	買建	27	679,954,061	661,418,719	0.06
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec23	買建	25	416,944,098	403,427,118	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年10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	ＩＣＥ－ＵＳ	MINI MSCI EMG MKT Dec23	買建	594	4,211,978,526	4,108,745,609	5.29

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０５１２月	買建	2,857	5,444,299,200	5,174,027,000	2.87

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2023年10月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2017年10月12日)	112	112	1.0290	1.0290
第2計算期間末(2018年10月12日)	1,235	1,235	1.0184	1.0184
第3計算期間末(2019年10月15日)	4,942	4,942	1.1136	1.1136
第4計算期間末(2020年10月12日)	11,727	11,727	1.1224	1.1224
第5計算期間末(2021年10月12日)	23,472	23,472	1.3254	1.3254
第6計算期間末(2022年10月12日)	34,559	34,559	1.2874	1.2874
第7計算期間末(2023年10月12日)	52,263	52,263	1.4314	1.4314
2022年10月末日	36,660	－	1.3354	－
11月末日	37,697	－	1.3342	－
12月末日	37,234	－	1.2763	－
2023年1月末日	39,351	－	1.3088	－
2月末日	40,735	－	1.3224	－
3月末日	41,731	－	1.3128	－

4月末日	43,505	－	1.3361	－
5月末日	45,309	－	1.3691	－
6月末日	48,416	－	1.4318	－
7月末日	49,684	－	1.4362	－
8月末日	51,376	－	1.4498	－
9月末日	51,528	－	1.4223	－
10月末日	51,413	－	1.3868	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	2.9
第2計算期間	△1.0
第3計算期間	9.3
第4計算期間	0.8
第5計算期間	18.1
第6計算期間	△2.9
第7計算期間	11.2

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

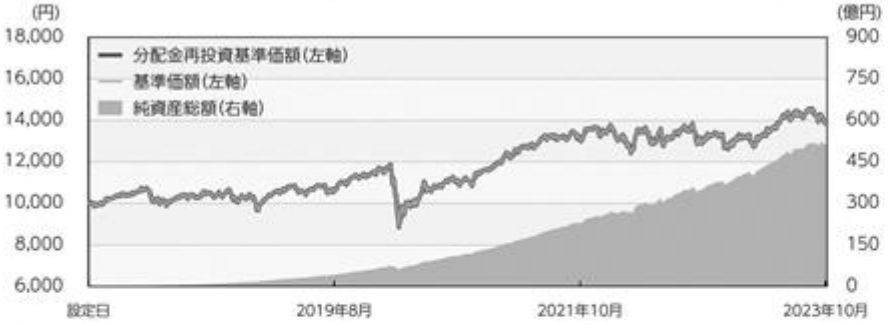
	設定口数	解約口数
第1計算期間	142,369,436	33,239,388
第2計算期間	1,297,676,916	193,210,405
第3計算期間	3,533,764,610	309,330,624
第4計算期間	6,836,190,761	825,346,388
第5計算期間	8,794,080,441	1,532,316,002
第6計算期間	10,792,295,406	1,658,261,496
第7計算期間	12,402,882,952	2,735,298,757

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2023年10月31日

基準価額・純資産の推移 《2017年7月28日～2023年10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、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2017年7月28日)

分配の推移(税引前)

2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
2022年10月	0円
2023年10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	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	12.70
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.65
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	12.57
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	12.53
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	12.41
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.28
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.28
8	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.98

■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	4.32
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.67
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.35
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.77
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.60

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	145回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.34
2	340回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	1.22
3	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.11
4	363回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2031/6/20	1.01
5	366回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.2	2032/3/20	1.01

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2023年10月31日

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.33
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.74
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.44
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.02
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	1.47

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.51
2	US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	アメリカ	1.5	2024/11/30	0.48
3	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.48
4	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.47
5	US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	アメリカ	1.875	2032/2/15	0.46

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	6.06
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.80
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.58
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.58
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.28

■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	2.59
2	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	2.16
3	COLOMBIA 7.5 02/02/34	国債証券	コロンビア	7.5	2034/2/2	1.99
4	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.93
5	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	国債証券	アラブ首長国連邦	2.125	2024/9/30	1.83

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2023年10月31日

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.65
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.41
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.07
4	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.40
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.39

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	8.21
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	6.02
3	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	3.81
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.39
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.32

年間収益率の推移（暦年ベース）

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2017年は設定日から年末までの収益率、および2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金自動けいぞく投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

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

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

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

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

受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

※委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請

求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。
※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日※における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
不動産投資信託証券	計算日※における金融商品取引所等の最終相場

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2017年7月28日から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12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発します。

c.上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.にお

いて同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

e.上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

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

g.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ.信託約款の変更等

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

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

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

f.上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

h.委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

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10月12日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL　https://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。
受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。
収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（2022年10月13日から2023年10月12日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【たわらノーロード　バランス（８資産均等型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2022年10月12日現在	第7期 2023年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	523,645,094	426,181,903
親投資信託受益証券	34,100,707,079	51,928,425,469
流動資産合計	34,624,352,173	52,354,607,372
資産合計	34,624,352,173	52,354,607,372
負債の部		
流動負債		
未払解約金	39,050,936	56,509,044
未払受託者報酬	3,580,489	5,288,716
未払委託者報酬	21,483,165	29,088,104
その他未払費用	514,902	666,949
流動負債合計	64,629,492	91,552,813
負債合計	64,629,492	91,552,813
純資産の部		
元本等		
元本	26,844,673,267	36,512,257,462
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,715,049,414	15,750,797,097
（分配準備積立金）	3,446,497,792	5,927,919,052
元本等合計	34,559,722,681	52,263,054,559
純資産合計	34,559,722,681	52,263,054,559
負債純資産合計	34,624,352,173	52,354,607,372

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自　2021年10月13日 至　2022年10月12日	第7期 自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
営業収益		
受取利息	2,413	4,717
有価証券売買等損益	△1,011,581,573	4,685,696,390
営業収益合計	△1,011,579,160	4,685,701,107
営業費用		
支払利息	100,442	255,696
受託者報酬	6,477,178	9,514,814
委託者報酬	38,863,473	54,369,387
その他費用	967,892	1,238,245
営業費用合計	46,408,985	65,378,142
営業利益又は営業損失（△）	△1,057,988,145	4,620,322,965
経常利益又は経常損失（△）	△1,057,988,145	4,620,322,965
当期純利益又は当期純損失（△）	△1,057,988,145	4,620,322,965
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（△）	8,988,095	194,768,840
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,762,216,560	7,715,049,414
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,561,956,267	4,418,163,950
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	3,561,956,267	4,418,163,950
剰余金減少額又は欠損金増加額	542,147,173	807,970,392
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	542,147,173	807,970,392
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（△）	7,715,049,414	15,750,797,097

（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7期 自　2022年10月13日 至　2023年10月12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6期 2022年10月12日現在	第7期 2023年10月12日現在
１．　期首元本額	17,710,639,357円	26,844,673,267円
期中追加設定元本額	10,792,295,406円	12,402,882,952円
期中一部解約元本額	1,658,261,496円	2,735,298,757円
２．　受益権の総数	26,844,673,267口	36,512,257,462口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第6期 自　2021年10月13日 至　2022年10月12日	第7期 自　2022年10月13日 至　2023年10月12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（743,470,428円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（4,424,872,335円）及び分配準備積立金（2,703,027,364円）より分配対象収益は7,871,370,127円（1万口当たり2,932.19円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,234,111,512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（1,528,932,478円）、信託約款に規定される収益調整金（9,822,878,045円）及び分配準備積立金（3,164,875,062円）より分配対象収益は15,750,797,097円（1万口当たり4,313.83円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自　2021年10月13日 至　2022年10月12日	第7期 自　2022年10月13日 至　2023年10月12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。	同左
３． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 2022年10月12日現在	第7期 2023年10月12日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第6期 2022年10月12日現在	第7期 2023年10月12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	△1,011,588,004	4,680,559,192
合計	△1,011,588,004	4,680,559,192

（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6期 2022年10月12日現在	第7期 2023年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2874円 (12,874円)	1.4314円 (14,314円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
（１）株式
該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2023年10月12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	1,626,723,716	6,636,707,416	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,033,325,596	6,206,090,459	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	2,713,955,466	6,441,030,507	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	890,697,093	6,525,335,973	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,950,228,327	6,494,042,593	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,857,298,738	6,612,952,956	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4,283,684,474	6,522,337,980	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	3,011,008,437	6,489,927,585	
親投資信託受益証券　合計		24,366,921,847	51,928,425,469	
合計			51,928,425,469	

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,503,948,288
株式	444,182,914,222
派生商品評価勘定	89,707,070
未収入金	24,300,000
未収配当金	4,215,702,089
前払金	299,085,000
差入委託証拠金	594,900,000
流動資産合計	459,910,556,669
資産合計	459,910,556,669
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	123,765,580
未払金	1,339,240
未払解約金	51,716,000
流動負債合計	176,820,820
負債合計	176,820,820
純資産の部	
元本等	
元本	112,686,450,204
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	347,047,285,645
元本等合計	459,733,735,849
純資産合計	459,733,735,849
負債純資産合計	459,910,556,669

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月12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	107,927,334,401円
同期中追加設定元本額	53,851,586,217円
同期中一部解約元本額	49,092,470,414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	2,512,625,333円
たわらノーロード　国内株式＜ラップ専用＞	3,586,597,917円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	29,121,760,756円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	4,401,330,363円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,577,038円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,859,916円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	22,495,249円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	22,295,530円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	29,115,689円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	18,397,544円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	2,049,050,774円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,626,723,716円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	51,075,054円
たわらノーロード　バランス（標準型）	365,096,316円
たわらノーロード　バランス（積極型）	595,293,571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）	2,907,975円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	164,505,955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）	437,210,881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）	362,152,461円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	504,390,407円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	371,533円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,589,025円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	32,965,897円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,939,846円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	13,154,165円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,538,947,122円
Ｏｎｅグローバルバランス	32,095,260円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	950,415,986円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,447,249,653円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,882,608,040円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	300,585,907円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	992,462,675円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,095,836,822円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	28,659,474円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	14,869,106円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	293,211,405円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	337,492,851円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	565,503,647円
投資のソムリエ	3,310,099,946円
クルーズコントロール	278,711,267円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	290,273,338円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	337,879,725円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,034,651,249円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	299,882,386円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,078,786,747円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	79,310,296円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	40,668,771円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,361,059円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	153,283,554円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	496,233,407円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	839,720,855円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	246,047,248円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	82,559,302円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	43,368,524円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	26,376,013円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	465,002,560円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	6,234,204円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,768,617円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	39,261,075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）	45,467,009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）	46,552,094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）	31,776,416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）	28,427,281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）	44,898,506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）	116,323,835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）	195,958,753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）	40,537,536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）	200,272,560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）	529,776,926円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	95,527,088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）	35,660,100円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,161,101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）	91,491,514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）	76,030,336円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	1,573,454円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	38,403,888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）	68,508,553円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,723,005円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,153,870円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,595,132円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	82,709円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,602,238円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,087,301円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	317,661,964円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	432,387,293円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,301,841,503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）	10,994,055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）	16,546,442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）	164,147,687円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	27,257,477円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,430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）	188,089,684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）	10,755,214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）	40,506,025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）	94,887,494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）	142,115,636円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,869,699円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,564,100円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	27,892,629円
コア資産形成ファンド	16,711,663円
ＭＨＡＭトピックスファンド	807,637,034円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	45,136,872円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	3,482,341,044円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,893,889,656円
計	112,686,450,204円
２．　受益権の総数	112,686,450,204口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	64,455,854,775
合計	64,455,854,775

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月8日から2023年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	15,202,760,000	－	15,168,915,000	△33,845,000
合計	15,202,760,000	－	15,168,915,000	△33,845,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.0798円 (40,798円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,100	3,845.00	27,299,500	
ニッスイ	187,100	717.50	134,244,250	
マルハニチロ	27,800	2,514.50	69,903,100	
雪国まいたけ	15,900	896.00	14,246,400	
カネコ種苗	5,700	1,408.00	8,025,600	
サカタのタネ	21,300	4,235.00	90,205,500	
ホクト	16,600	1,813.00	30,095,800	
ホクリヨウ	1,800	1,104.00	1,987,200	
ショーボンドホールディングス	25,500	5,775.00	147,262,500	
ミライト・ワン	61,900	1,942.00	120,209,800	
タマホーム	11,800	3,315.00	39,117,000	
サンヨーホームズ	1,600	721.00	1,153,600	
日本アクア	5,200	982.00	5,106,400	
ファーストコーポレーション	3,200	771.00	2,467,200	
ベステラ	2,600	1,027.00	2,670,200	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	36,500	193.00	7,044,500	

キャンディル	2,300	564.00	1,297,200	
住石ホールディングス	19,400	531.00	10,301,400	
日鉄鉱業	7,500	4,760.00	35,700,000	
三井松島ホールディングス	8,600	2,626.00	22,583,600	
ＩＮＰＥＸ	692,100	2,058.50	1,424,687,850	
石油資源開発	21,700	5,130.00	111,321,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8,600	2,664.00	22,910,400	
ダイセキ環境ソリューション	2,500	1,031.00	2,577,500	
第一カッター興業	4,800	1,246.00	5,980,800	
明豊ファシリティワークス	4,600	718.00	3,302,800	
安藤・間	108,400	1,163.00	126,069,200	
東急建設	53,300	763.00	40,667,900	
コムシスホールディングス	59,800	3,110.00	185,978,000	
ビーアールホールディングス	29,800	360.00	10,728,000	
高松コンストラクショングループ	12,200	2,774.00	33,842,800	
東建コーポレーション	5,300	7,870.00	41,711,000	
ソネック	1,400	968.00	1,355,200	
ヤマウラ	9,500	1,230.00	11,685,000	
オリエンタル白石	67,100	321.00	21,539,100	
大成建設	122,500	5,146.00	630,385,000	
大林組	468,200	1,322.00	618,960,400	
清水建設	371,200	1,039.00	385,676,800	
飛島建設	14,400	1,304.00	18,777,600	
長谷工コーポレーション	135,200	1,900.50	256,947,600	
松井建設	12,200	763.00	9,308,600	
錢高組	1,100	3,720.00	4,092,000	
鹿島建設	290,300	2,492.00	723,427,600	
不動テトラ	9,000	2,030.00	18,270,000	
大末建設	3,100	1,453.00	4,504,300	
鉄建建設	9,400	2,057.00	19,335,800	
西松建設	22,300	3,557.00	79,321,100	
三井住友建設	105,500	385.00	40,617,500	
大豊建設	5,300	3,875.00	20,537,500	
佐田建設	5,500	578.00	3,179,000	
ナカノフドー建設	6,200	398.00	2,467,600	
奥村組	21,200	4,435.00	94,022,000	
東鉄工業	18,100	2,904.00	52,562,400	
イチケン	1,900	2,051.00	3,896,900	
富士ピー・エス	3,800	457.00	1,736,600	
淺沼組	10,400	3,610.00	37,544,000	
戸田建設	161,100	809.00	130,329,900	
熊谷組	21,900	3,605.00	78,949,500	
北野建設	1,700	3,000.00	5,100,000	
植木組	2,400	1,442.00	3,460,800	
矢作建設工業	17,800	1,275.00	22,695,000	
ピーエス三菱	16,600	821.00	13,628,600	
日本ハウスホールディングス	27,800	372.00	10,341,600	
大東建託	48,200	15,855.00	764,211,000	
新日本建設	18,400	1,234.00	22,705,600	
東亜道路工業	5,200	5,240.00	27,248,000	

日本道路	13,100	1,915.00	25,086,500	
東亜建設工業	11,300	3,655.00	41,301,500	
日本国土開発	37,100	645.00	23,929,500	
若築建設	5,700	3,005.00	17,128,500	
東洋建設	42,400	1,225.00	51,940,000	
五洋建設	185,600	871.30	161,713,280	
世紀東急工業	16,700	1,572.00	26,252,400	
福田組	5,000	4,830.00	24,150,000	
日本ドライケミカル	2,100	2,204.00	4,628,400	
住友林業	113,100	3,767.00	426,047,700	
日本基礎技術	5,300	476.00	2,522,800	
巴コーポレーション	9,800	574.00	5,625,200	
大和ハウス工業	362,000	4,130.00	1,495,060,000	
ライト工業	24,200	1,966.00	47,577,200	
積水ハウス	397,000	2,872.50	1,140,382,500	
日特建設	12,400	1,071.00	13,280,400	
北陸電気工事	9,000	1,005.00	9,045,000	
ユアテック	28,700	960.00	27,552,000	
日本リーテック	11,500	1,307.00	15,030,500	
四電工	5,400	2,918.00	15,757,200	
中電工	20,400	2,376.00	48,470,400	
関電工	71,800	1,325.00	95,135,000	
きんでん	92,200	2,159.50	199,105,900	
東京エネシス	13,000	976.00	12,688,000	
トーエネック	4,400	4,135.00	18,194,000	
住友電設	12,400	2,723.00	33,765,200	
日本電設工業	21,500	2,065.00	44,397,500	
エクシオグループ	60,400	3,075.00	185,730,000	
新日本空調	7,300	2,376.00	17,344,800	
九電工	31,900	4,540.00	144,826,000	
三機工業	29,000	1,613.00	46,777,000	
日揮ホールディングス	129,500	1,950.00	252,525,000	
中外炉工業	4,300	2,239.00	9,627,700	
ヤマト	7,300	903.00	6,591,900	
太平電業	8,100	4,115.00	33,331,500	
高砂熱学工業	31,600	2,840.00	89,744,000	
三晃金属工業	1,100	4,140.00	4,554,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	44,700	2,044.00	91,366,800	
朝日工業社	5,400	2,477.00	13,375,800	
明星工業	22,600	1,054.00	23,820,400	
大氣社	15,100	4,550.00	68,705,000	
ダイダン	17,300	1,500.00	25,950,000	
日比谷総合設備	10,800	2,271.00	24,526,800	
ニップン	35,400	2,197.00	77,773,800	
日清製粉グループ本社	121,600	1,838.50	223,561,600	
日東富士製粉	2,200	4,895.00	10,769,000	
昭和産業	11,500	3,035.00	34,902,500	
鳥越製粉	7,800	681.00	5,311,800	
中部飼料	18,300	1,100.00	20,130,000	
フィード・ワン	19,300	769.00	14,841,700	

東洋精糖	1,700	1,916.00	3,257,200	
日本甜菜製糖	7,700	1,892.00	14,568,400	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	13,100	2,965.00	38,841,500	
塩水港精糖	10,700	247.00	2,642,900	
ウェルネオシュガー	6,800	2,022.00	13,749,600	
ＬＩＦＵＬＬ	46,900	230.00	10,787,000	
ＭＩＸＩ	31,200	2,293.00	71,541,600	
ジェイエイシーリクルートメント	12,400	2,504.00	31,049,600	
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	235,400	699.60	164,685,840	
メンバーズ	4,100	1,172.00	4,805,200	
中広	1,000	428.00	428,000	
ＵＴグループ	20,200	2,197.00	44,379,400	
アイティメディア	5,200	1,148.00	5,969,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	8,000	1,641.00	13,128,000	
オープンアップグループ	41,100	1,906.00	78,336,600	
コシダカホールディングス	41,100	1,053.00	43,278,300	
アルトナー	2,200	1,712.00	3,766,400	
パソナグループ	16,600	1,585.00	26,311,000	
ＣＤＳ	2,300	1,701.00	3,912,300	
リンクアンドモチベーション	39,500	413.00	16,313,500	
エス・エム・エス	52,100	2,500.00	130,250,000	
サニーサイドアップグループ	2,700	835.00	2,254,500	
パーソルホールディングス	1,513,200	241.10	364,832,520	
リニカル	5,200	641.00	3,333,200	
クックパッド	37,500	118.00	4,425,000	
エスクリ	3,700	305.00	1,128,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,500	710.00	3,195,000	
森永製菓	23,400	5,301.00	124,043,400	
中村屋	3,200	3,100.00	9,920,000	
江崎グリコ	37,500	4,151.00	155,662,500	
名糖産業	5,200	1,606.00	8,351,200	
井村屋グループ	7,200	2,300.00	16,560,000	
不二家	9,000	2,496.00	22,464,000	
山崎製パン	88,000	2,630.00	231,440,000	
第一屋製パン	1,800	453.00	815,400	
モロゾフ	4,300	3,695.00	15,888,500	
亀田製菓	8,400	4,105.00	34,482,000	
寿スピリッツ	70,000	2,330.00	163,100,000	
カルビー	60,200	2,731.50	164,436,300	
森永乳業	23,800	5,519.00	131,352,200	
六甲バター	9,600	1,384.00	13,286,400	
ヤクルト本社	187,700	3,685.00	691,674,500	
明治ホールディングス	161,100	3,691.00	594,620,100	
雪印メグミルク	31,800	2,294.00	72,949,200	
プリマハム	17,700	2,351.00	41,612,700	
日本ハム	51,300	4,380.00	224,694,000	
林兼産業	2,700	559.00	1,509,300	
丸大食品	13,300	1,624.00	21,599,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	14,500	3,225.00	46,762,500	
柿安本店	5,100	2,456.00	12,525,600	

伊藤ハム米久ホールディングス	20,040	4,010.00	80,360,400	
学情	7,000	1,866.00	13,062,000	
スタジオアリス	6,800	2,045.00	13,906,000	
クロスキャット	7,600	1,035.00	7,866,000	
シミックホールディングス	6,600	1,713.00	11,305,800	
エプコ	2,500	768.00	1,920,000	
システナ	225,100	263.00	59,201,300	
ＮＪＳ	3,000	2,875.00	8,625,000	
デジタルアーツ	8,500	4,440.00	37,740,000	
日鉄ソリューションズ	22,900	4,255.00	97,439,500	
綜合警備保障	254,700	881.50	224,518,050	
キューブシステム	7,900	1,111.00	8,776,900	
いちご	151,400	326.00	49,356,400	
日本駐車場開発	139,100	205.00	28,515,500	
コア	6,000	1,692.00	10,152,000	
カカクコム	100,700	1,438.50	144,856,950	
アイロムグループ	5,000	1,802.00	9,010,000	
セントケア・ホールディング	8,800	853.00	7,506,400	
サイネックス	1,600	812.00	1,299,200	
ルネサンス	9,600	876.00	8,409,600	
ディップ	24,000	3,565.00	85,560,000	
ＳＢＳホールディングス	11,900	2,695.00	32,070,500	
デジタルホールディングス	7,100	995.00	7,064,500	
新日本科学	14,500	1,824.00	26,448,000	
キャリアデザインセンター	1,900	1,807.00	3,433,300	
ベネフィット・ワン	63,500	1,010.00	64,135,000	
エムスリー	271,100	2,648.00	717,872,800	
ツカダ・グローバルホールディング	5,900	404.00	2,383,600	
ブラス	1,000	646.00	646,000	
アウトソーシング	88,100	1,159.00	102,107,900	
ウェルネット	7,000	556.00	3,892,000	
ワールドホールディングス	6,200	2,414.00	14,966,800	
ディー・エヌ・エー	54,900	1,473.50	80,895,150	
博報堂ＤＹホールディングス	175,000	1,250.00	218,750,000	
ぐるなび	25,200	308.00	7,761,600	
タカミヤ	18,600	496.00	9,225,600	
ジャパンベストレスキューシステム	6,800	665.00	4,522,000	
ファンコミュニケーションズ	19,300	399.00	7,700,700	
ライク	5,100	1,420.00	7,242,000	
Ａｏｂａ‐ＢＢＴ	3,400	390.00	1,326,000	
エスプール	39,500	354.00	13,983,000	
ＷＤＢホールディングス	7,000	2,059.00	14,413,000	
手間いらず	2,200	2,163.00	4,758,600	
ティア	5,300	450.00	2,385,000	
ＣＤＧ	1,000	1,263.00	1,263,000	
アドウェイズ	18,900	554.00	10,470,600	
バリューコマース	12,100	1,250.00	15,125,000	
インフォマート	142,500	391.00	55,717,500	
サッポロホールディングス	43,300	5,012.00	217,019,600	
アサヒグループホールディングス	303,700	5,567.00	1,690,697,900	

キリンホールディングス	547,500	2,111.50	1,156,046,250	
宝ホールディングス	89,600	1,268.00	113,612,800	
オエノンホールディングス	39,200	415.00	16,268,000	
養命酒製造	4,400	1,844.00	8,113,600	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	103,000	1,855.00	191,065,000	
ライフドリンク　カンパニー	2,400	3,360.00	8,064,000	
サントリー食品インターナショナル	92,600	4,472.00	414,107,200	
ダイドーグループホールディングス	7,400	5,530.00	40,922,000	
伊藤園	44,500	4,653.00	207,058,500	
キーコーヒー	14,700	1,996.00	29,341,200	
ユニカフェ	2,900	945.00	2,740,500	
ジャパンフーズ	1,500	1,100.00	1,650,000	
日清オイリオグループ	18,500	4,035.00	74,647,500	
不二製油グループ本社	30,600	2,234.00	68,360,400	
かどや製油	1,100	3,460.00	3,806,000	
Ｊ－オイルミルズ	13,400	1,769.00	23,704,600	
ローソン	35,000	6,691.00	234,185,000	
サンエー	10,800	5,000.00	54,000,000	
カワチ薬品	11,100	2,493.00	27,672,300	
エービーシー・マート	61,900	2,492.00	154,254,800	
ハードオフコーポレーション	3,800	1,477.00	5,612,600	
高千穂交易	3,300	3,265.00	10,774,500	
アスクル	29,300	1,957.00	57,340,100	
ゲオホールディングス	13,800	2,349.00	32,416,200	
アダストリア	17,000	3,120.00	53,040,000	
ジーフット	6,500	279.00	1,813,500	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,300	708.00	920,400	
オルバヘルスケアホールディングス	1,500	1,832.00	2,748,000	
伊藤忠食品	3,100	6,500.00	20,150,000	
くら寿司	16,500	3,390.00	55,935,000	
キャンドゥ	5,000	2,465.00	12,325,000	
エレマテック	12,600	1,844.00	23,234,400	
ＩＫホールディングス	2,900	364.00	1,055,600	
パルグループホールディングス	27,800	1,985.00	55,183,000	
エディオン	55,900	1,484.00	82,955,600	
あらた	10,800	5,440.00	58,752,000	
サーラコーポレーション	29,700	737.00	21,888,900	
ワッツ	4,600	574.00	2,640,400	
トーメンデバイス	2,000	5,050.00	10,100,000	
ハローズ	6,400	4,135.00	26,464,000	
ＪＰホールディングス	39,500	334.00	13,193,000	
フジオフードグループ本社	15,900	1,378.00	21,910,200	
あみやき亭	3,400	3,720.00	12,648,000	
東京エレクトロン　デバイス	15,500	3,775.00	58,512,500	
ひらまつ	20,200	241.00	4,868,200	
円谷フィールズホールディングス	24,200	1,802.00	43,608,400	
双日	140,700	3,225.00	453,757,500	
アルフレッサ　ホールディングス	141,800	2,419.00	343,014,200	
大黒天物産	4,400	6,670.00	29,348,000	

ハニーズホールディングス	11,200	1,502.00	16,822,400	
ファーマライズホールディングス	2,100	649.00	1,362,900	
キッコーマン	87,000	8,450.00	735,150,000	
味の素	317,300	5,922.00	1,879,050,600	
ブルドックソース	6,900	2,070.00	14,283,000	
キユーピー	70,600	2,590.50	182,889,300	
ハウス食品グループ本社	40,200	3,177.00	127,715,400	
カゴメ	56,500	3,208.00	181,252,000	
焼津水産化学工業	3,400	1,312.00	4,460,800	
アリアケジャパン	11,500	4,693.00	53,969,500	
ピエトロ	1,400	1,822.00	2,550,800	
エバラ食品工業	3,600	2,890.00	10,404,000	
やまみ	800	2,149.00	1,719,200	
ニチレイ	60,200	3,269.00	196,793,800	
横浜冷凍	38,500	1,163.00	44,775,500	
東洋水産	66,300	6,005.00	398,131,500	
イートアンドホールディングス	5,700	2,004.00	11,422,800	
大冷	1,100	1,928.00	2,120,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,400	1,125.00	9,450,000	
日清食品ホールディングス	46,200	12,590.00	581,658,000	
永谷園ホールディングス	6,500	2,212.00	14,378,000	
一正蒲鉾	3,900	749.00	2,921,100	
フジッコ	13,500	1,921.00	25,933,500	
ロック・フィールド	14,700	1,546.00	22,726,200	
日本たばこ産業	798,700	3,420.00	2,731,554,000	
ケンコーマヨネーズ	9,000	1,495.00	13,455,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,600	3,065.00	29,424,000	
なとり	8,400	1,976.00	16,598,400	
イフジ産業	1,600	1,699.00	2,718,400	
ファーマフーズ	18,900	1,418.00	26,800,200	
北の達人コーポレーション	56,300	229.00	12,892,700	
ユーグレナ	81,800	762.00	62,331,600	
紀文食品	10,200	1,147.00	11,699,400	
ピックルスホールディングス	7,700	1,170.00	9,009,000	
スター・マイカ・ホールディングス	15,400	644.00	9,917,600	
ＳＲＥホールディングス	6,500	2,637.00	17,140,500	
ＡＤワークスグループ	22,400	263.00	5,891,200	
片倉工業	12,300	1,751.00	21,537,300	
グンゼ	9,500	4,545.00	43,177,500	
ヒューリック	306,700	1,383.50	424,319,450	
神栄	1,300	1,691.00	2,198,300	
ラサ商事	4,400	1,671.00	7,352,400	
アルペン	11,700	1,932.00	22,604,400	
ハブ	3,000	794.00	2,382,000	
ラクーンホールディングス	11,100	747.00	8,291,700	
クオールホールディングス	19,400	1,803.00	34,978,200	
アルコニックス	18,600	1,356.00	25,221,600	
神戸物産	109,300	3,774.00	412,498,200	
ソリトンシステムズ	6,900	1,127.00	7,776,300	
ジンズホールディングス	8,500	3,610.00	30,685,000	

ビックカメラ	75,200	1,132.00	85,126,400	
ＤＣＭホールディングス	82,100	1,284.00	105,416,400	
ペッパーフードサービス	29,400	112.00	3,292,800	
ハイパー	2,000	337.00	674,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	200,200	1,304.00	261,060,800	
東京一番フーズ	2,300	507.00	1,166,100	
ＤＤグループ	6,100	1,861.00	11,352,100	
あい　ホールディングス	22,700	2,360.00	53,572,000	
ディーブイエックス	2,600	1,078.00	2,802,800	
きちりホールディングス	2,200	906.00	1,993,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	175,500	1,485.00	260,617,500	
ドトール・日レスホールディングス	25,100	2,276.00	57,127,600	
マツキヨココカラ＆カンパニー	257,000	2,669.00	685,933,000	
ブロンコビリー	8,400	2,996.00	25,166,400	
ＺＯＺＯ	93,400	2,920.50	272,774,700	
トレジャー・ファクトリー	5,700	1,180.00	6,726,000	
物語コーポレーション	23,500	3,955.00	92,942,500	
三越伊勢丹ホールディングス	237,800	1,715.00	407,827,000	
東洋紡	57,800	1,021.50	59,042,700	
ユニチカ	40,300	196.00	7,898,800	
富士紡ホールディングス	5,300	3,520.00	18,656,000	
日清紡ホールディングス	101,400	1,107.00	112,249,800	
倉敷紡績	9,900	2,363.00	23,393,700	
ダイワボウホールディングス	57,800	2,889.00	166,984,200	
シキボウ	4,800	1,072.00	5,145,600	
日東紡績	15,000	3,925.00	58,875,000	
トヨタ紡織	56,200	2,692.00	151,290,400	
マクニカホールディングス	33,400	7,650.00	255,510,000	
Ｈａｍｅｅ	4,900	880.00	4,312,000	
マーケットエンタープライズ	900	1,400.00	1,260,000	
ラクト・ジャパン	5,400	2,053.00	11,086,200	
ウエルシアホールディングス	73,200	2,511.00	183,805,200	
クリエイトＳＤホールディングス	23,300	3,170.00	73,861,000	
グリムス	5,900	2,198.00	12,968,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,600	1,037.00	18,251,200	
八洲電機	11,500	1,308.00	15,042,000	
メディアスホールディングス	9,000	777.00	6,993,000	
レスターホールディングス	13,500	2,545.00	34,357,500	
ジオリーブグループ	2,200	1,182.00	2,600,400	
丸善ＣＨＩホールディングス	11,200	335.00	3,752,000	
大光	4,000	675.00	2,700,000	
ＯＣＨＩホールディングス	2,100	1,395.00	2,929,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	69,600	942.00	65,563,200	
黒谷	2,600	595.00	1,547,000	
ミサワ	1,800	615.00	1,107,000	
ティーライフ	1,300	1,370.00	1,781,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,800	849.00	1,528,200	
エー・ピーホールディングス	1,900	872.00	1,656,800	
三洋貿易	15,900	1,311.00	20,844,900	

チムニー	2,900	1,381.00	4,004,900	
シュッピン	10,600	1,111.00	11,776,600	
ビューティガレージ	2,200	4,815.00	10,593,000	
オイシックス・ラ・大地	19,000	1,275.00	24,225,000	
ウイン・パートナーズ	10,200	1,090.00	11,118,000	
ネクステージ	32,300	2,161.00	69,800,300	
ジョイフル本田	41,100	1,750.00	71,925,000	
鳥貴族ホールディングス	5,200	3,015.00	15,678,000	
ホットランド	10,900	1,902.00	20,731,800	
すかいらーくホールディングス	193,000	2,145.00	413,985,000	
ＳＦＰホールディングス	7,700	2,156.00	16,601,200	
綿半ホールディングス	11,000	1,310.00	14,410,000	
日本毛織	35,200	1,347.00	47,414,400	
ダイトウボウ	14,000	91.00	1,274,000	
トーア紡コーポレーション	3,400	444.00	1,509,600	
ダイドーリミテッド	12,700	327.00	4,152,900	
ヨシックスホールディングス	1,800	2,730.00	4,914,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	46,000	1,041.00	47,886,000	
野村不動産ホールディングス	82,200	3,868.00	317,949,600	
三重交通グループホールディングス	28,000	540.00	15,120,000	
サムティ	20,900	2,380.00	49,742,000	
ディア・ライフ	22,500	767.00	17,257,500	
コーセーアールイー	2,700	978.00	2,640,600	
地主	10,000	1,960.00	19,600,000	
プレサンスコーポレーション	20,800	1,734.00	36,067,200	
フィル・カンパニー	2,000	676.00	1,352,000	
ＴＨＥグローバル社	5,100	390.00	1,989,000	
ハウスコム	1,500	903.00	1,354,500	
ＪＰＭＣ	7,600	1,148.00	8,724,800	
サンセイランディック	2,500	1,033.00	2,582,500	
エストラスト	1,100	647.00	711,700	
フージャースホールディングス	20,300	1,074.00	21,802,200	
オープンハウスグループ	48,100	5,104.00	245,502,400	
東急不動産ホールディングス	395,300	948.00	374,744,400	
飯田グループホールディングス	111,900	2,420.50	270,853,950	
イーグランド	1,400	1,500.00	2,100,000	
ムゲンエステート	5,900	1,035.00	6,106,500	
帝国繊維	15,000	1,867.00	28,005,000	
日本コークス工業	120,800	115.00	13,892,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,400	718.00	4,595,200	
ミタチ産業	2,400	1,055.00	2,532,000	
ＢＥＥＮＯＳ	6,000	1,606.00	9,636,000	
あさひ	11,800	1,257.00	14,832,600	
日本調剤	9,500	1,436.00	13,642,000	
コスモス薬品	14,000	14,200.00	198,800,000	
シップヘルスケアホールディングス	50,800	2,294.50	116,560,600	
トーエル	4,200	752.00	3,158,400	
ソフトクリエイトホールディングス	11,000	1,802.00	19,822,000	
セブン&アイ・ホールディングス	486,700	5,758.00	2,802,418,600	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	106,300	1,081.00	114,910,300	
明治電機工業	5,300	1,406.00	7,451,800	
ツルハホールディングス	29,700	10,600.00	314,820,000	
デリカフーズホールディングス	3,700	629.00	2,327,300	
スターティアホールディングス	1,800	1,617.00	2,910,600	
サンマルクホールディングス	11,400	1,898.00	21,637,200	
フェリシモ	2,100	956.00	2,007,600	
トリドールホールディングス	35,100	3,605.00	126,535,500	
帝人	128,400	1,424.00	182,841,600	
東レ	895,900	756.30	677,569,170	
クラレ	194,900	1,760.50	343,121,450	
旭化成	835,000	944.80	788,908,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,500	299.00	4,335,500	
稲葉製作所	7,200	1,522.00	10,958,400	
宮地エンジニアリンググループ	7,600	3,040.00	23,104,000	
トーカロ	36,700	1,404.00	51,526,800	
アルファ	3,300	1,463.00	4,827,900	
ＳＵＭＣＯ	244,700	2,021.00	494,538,700	
川田テクノロジーズ	3,200	6,180.00	19,776,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	9,200	2,858.00	26,293,600	
ジェイテックコーポレーション	1,300	2,452.00	3,187,600	
信和	5,100	745.00	3,799,500	
ビーロット	6,100	846.00	5,160,600	
ファーストブラザーズ	1,800	1,165.00	2,097,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	7,800	1,013.00	7,901,400	
シーアールイー	7,300	1,686.00	12,307,800	
ケイアイスター不動産	6,300	4,500.00	28,350,000	
アグレ都市デザイン	1,600	1,535.00	2,456,000	
グッドコムアセット	12,200	1,081.00	13,188,200	
ジェイ・エス・ビー	3,200	5,220.00	16,704,000	
ロードスターキャピタル	8,600	1,949.00	16,761,400	
テンポイノベーション	2,600	1,141.00	2,966,600	
グローバル・リンク・マネジメント	1,800	2,148.00	3,866,400	
フェイスネットワーク	2,300	1,376.00	3,164,800	
住江織物	1,800	2,131.00	3,835,800	
日本フエルト	5,000	420.00	2,100,000	
イチカワ	1,100	1,511.00	1,662,100	
エコナックホールディングス	7,950	147.00	1,168,650	
日東製網	900	1,432.00	1,288,800	
芦森工業	1,700	2,205.00	3,748,500	
アツギ	5,300	422.00	2,236,600	
ウイルプラスホールディングス	1,600	1,235.00	1,976,000	
ＪＭホールディングス	10,700	1,976.00	21,143,200	
コメダホールディングス	34,600	2,778.00	96,118,800	
サツドラホールディングス	4,300	752.00	3,233,600	
アレンザホールディングス	10,600	1,001.00	10,610,600	
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,658.00	6,300,400	
バロックジャパンリミテッド	9,100	796.00	7,243,600	
クスリのアオキホールディングス	12,500	9,356.00	116,950,000	

ダイニック	2,200	804.00	1,768,800	
共和レザー	5,200	639.00	3,322,800	
ピーバンドットコム	1,400	428.00	599,200	
力の源ホールディングス	5,300	1,877.00	9,948,100	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	75,300	2,612.50	196,721,250	
アセンテック	4,800	531.00	2,548,800	
セーレン	25,800	2,234.00	57,637,200	
ソトー	2,800	741.00	2,074,800	
東海染工	900	1,020.00	918,000	
小松マテーレ	19,400	725.00	14,065,000	
ワコールホールディングス	24,300	3,442.00	83,640,600	
ホギメディカル	18,000	3,230.00	58,140,000	
クラウディアホールディングス	2,000	446.00	892,000	
ＴＳＩホールディングス	45,000	775.00	34,875,000	
マツオカコーポレーション	2,400	1,559.00	3,741,600	
ワールド	17,100	1,615.00	27,616,500	
ＴＩＳ	146,500	3,253.00	476,564,500	
テクミラホールディングス	4,100	424.00	1,738,400	
グリー	35,800	577.00	20,656,600	
GMOペパボ	1,700	1,259.00	2,140,300	
コーエーテクモホールディングス	83,900	2,101.00	176,273,900	
三菱総合研究所	6,600	4,935.00	32,571,000	
ボルテージ	2,500	280.00	700,000	
電算	900	1,558.00	1,402,200	
ＡＧＳ	3,700	691.00	2,556,700	
ファインデックス	10,700	850.00	9,095,000	
ブレインパッド	10,000	863.00	8,630,000	
ＫＬａｂ	24,700	271.00	6,693,700	
ポールトゥウィンホールディングス	22,900	479.00	10,969,100	
ネクソン	298,500	2,706.00	807,741,000	
アイスタイル	39,700	489.00	19,413,300	
エムアップホールディングス	16,400	1,239.00	20,319,600	
エイチーム	7,900	582.00	4,597,800	
エニグモ	17,000	328.00	5,576,000	
テクノスジャパン	7,300	808.00	5,898,400	
ｅｎｉｓｈ	7,200	196.00	1,411,200	
コロプラ	51,800	580.00	30,044,000	
オルトプラス	7,500	191.00	1,432,500	
ブロードリーフ	63,500	547.00	34,734,500	
クロス・マーケティンググループ	5,300	681.00	3,609,300	
デジタルハーツホールディングス	8,400	919.00	7,719,600	
システム情報	10,700	928.00	9,929,600	
メディアドゥ	5,300	1,057.00	5,602,100	
じげん	39,000	542.00	21,138,000	
ブイキューブ	16,000	373.00	5,968,000	
エンカレッジ・テクノロジ	2,100	495.00	1,039,500	
サイバーリンクス	3,400	763.00	2,594,200	
ディー・エル・イー	6,300	242.00	1,524,600	
フィックスターズ	15,100	1,088.00	16,428,800	

ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,300	1,222.00	7,698,600	
オプティム	11,000	857.00	9,427,000	
セレス	5,300	944.00	5,003,200	
ＳＨＩＦＴ	8,900	28,045.00	249,600,500	
特種東海製紙	6,000	3,480.00	20,880,000	
ティーガイア	14,000	1,768.00	24,752,000	
セック	1,300	3,745.00	4,868,500	
テクマトリックス	24,400	1,589.00	38,771,600	
プロシップ	5,900	1,283.00	7,569,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,800	2,387.50	83,085,000	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	26,800	7,749.00	207,673,200	
ザッパラス	2,500	428.00	1,070,000	
システムリサーチ	4,200	3,120.00	13,104,000	
インターネットイニシアティブ	73,100	2,478.50	181,178,350	
さくらインターネット	15,000	1,271.00	19,065,000	
ヴィンクス	2,100	1,225.00	2,572,500	
ＧＭＯグローバルサイン・ホールディングス	4,100	2,697.00	11,057,700	
ＳＲＡホールディングス	6,900	3,495.00	24,115,500	
システムインテグレータ	2,600	417.00	1,084,200	
朝日ネット	14,300	612.00	8,751,600	
ｅＢＡＳＥ	18,900	673.00	12,719,700	
アバントグループ	16,900	1,281.00	21,648,900	
アドソル日進	5,600	1,666.00	9,329,600	
ＯＤＫソリューションズ	1,900	563.00	1,069,700	
フリービット	7,000	1,073.00	7,511,000	
コムチュア	17,700	2,264.00	40,072,800	
サイバーコム	1,500	1,269.00	1,903,500	
アステリア	10,400	702.00	7,300,800	
アイル	6,300	3,890.00	24,507,000	
王子ホールディングス	556,800	624.00	347,443,200	
日本製紙	69,600	1,336.00	92,985,600	
三菱製紙	10,800	600.00	6,480,000	
北越コーポレーション	84,500	1,005.00	84,922,500	
中越パルプ工業	3,700	1,370.00	5,069,000	
巴川製紙所	2,800	658.00	1,842,400	
大王製紙	59,000	1,221.00	72,039,000	
阿波製紙	2,100	493.00	1,035,300	
マークラインズ	7,200	2,913.00	20,973,600	
メディカル・データ・ビジョン	16,000	750.00	12,000,000	
ｇｕｍｉ	19,600	484.00	9,486,400	
ショーケース	2,000	316.00	632,000	
モバイルファクトリー	1,800	797.00	1,434,600	
テラスカイ	5,700	1,938.00	11,046,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,700	1,767.00	13,605,900	
ＰＣＩホールディングス	3,400	1,037.00	3,525,800	
アイビーシー	1,400	525.00	735,000	
ネオジャパン	4,500	1,007.00	4,531,500	

ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,300	1,600.00	5,280,000	
ラクス	63,300	2,066.00	130,777,800	
ランドコンピュータ	2,200	1,310.00	2,882,000	
ダブルスタンダード	5,300	1,546.00	8,193,800	
オープンドア	9,300	791.00	7,356,300	
マイネット	2,900	335.00	971,500	
アカツキ	6,400	2,039.00	13,049,600	
ベネフィットジャパン	500	1,191.00	595,500	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,200	1,178.00	4,947,600	
カナミックネットワーク	14,400	490.00	7,056,000	
ノムラシステムコーポレーション	9,600	113.00	1,084,800	
レンゴー	121,700	1,008.50	122,734,450	
トーモク	7,700	2,373.00	18,272,100	
ザ・パック	9,900	3,250.00	32,175,000	
チェンジホールディングス	32,800	1,659.00	54,415,200	
シンクロ・フード	5,600	560.00	3,136,000	
オークネット	5,300	1,750.00	9,275,000	
キャピタル・アセット・プランニング	1,800	767.00	1,380,600	
セグエグループ	2,800	1,018.00	2,850,400	
エイトレッド	1,400	1,427.00	1,997,800	
マクロミル	26,300	697.00	18,331,100	
ビーグリー	1,800	1,094.00	1,969,200	
オロ	4,900	2,176.00	10,662,400	
ユーザーローカル	4,900	1,715.00	8,403,500	
テモナ	2,000	267.00	534,000	
ニーズウェル	4,900	631.00	3,091,900	
マネーフォワード	29,800	5,084.00	151,503,200	
サインポスト	3,400	443.00	1,506,200	
レゾナック・ホールディングス	129,100	2,571.50	331,980,650	
住友化学	991,700	403.40	400,051,780	
住友精化	5,500	4,560.00	25,080,000	
日産化学	62,800	6,501.00	408,262,800	
ラサ工業	5,200	2,054.00	10,680,800	
クレハ	10,800	8,730.00	94,284,000	
多木化学	5,200	3,535.00	18,382,000	
テイカ	9,000	1,540.00	13,860,000	
石原産業	24,100	1,424.00	34,318,400	
片倉コープアグリ	1,800	1,113.00	2,003,400	
日本曹達	14,300	5,470.00	78,221,000	
東ソー	178,500	1,879.50	335,490,750	
トクヤマ	43,200	2,285.50	98,733,600	
セントラル硝子	21,500	2,933.00	63,059,500	
東亞合成	67,100	1,377.00	92,396,700	
大阪ソーダ	8,000	7,080.00	56,640,000	
関東電化工業	25,900	865.00	22,403,500	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	9,500	1,321.00	12,549,500	
デンカ	48,600	2,743.00	133,309,800	
イビデン	77,300	8,453.00	653,416,900	
信越化学工業	1,111,500	4,508.00	5,010,642,000	
日本カーバイド工業	3,300	1,787.00	5,897,100	

プラスアルファ・コンサルティング	7,700	2,858.00	22,006,600	
電算システムホールディングス	5,900	2,809.00	16,573,100	
堺化学工業	10,100	2,098.00	21,189,800	
第一稀元素化学工業	12,200	959.00	11,699,800	
エア・ウォーター	126,100	1,891.00	238,455,100	
日本酸素ホールディングス	129,700	3,712.00	481,446,400	
日本化学工業	4,500	1,952.00	8,784,000	
東邦アセチレン	1,800	1,626.00	2,926,800	
日本パーカライジング	66,100	1,103.00	72,908,300	
高圧ガス工業	19,400	774.00	15,015,600	
チタン工業	1,100	1,407.00	1,547,700	
四国化成ホールディングス	17,200	1,739.00	29,910,800	
戸田工業	3,000	1,876.00	5,628,000	
ステラ　ケミファ	7,900	3,220.00	25,438,000	
保土谷化学工業	3,800	3,160.00	12,008,000	
日本触媒	20,400	5,549.00	113,199,600	
大日精化工業	9,300	2,220.00	20,646,000	
カネカ	30,500	3,823.00	116,601,500	
協和キリン	161,700	2,622.00	423,977,400	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	45,700	1,590.00	72,663,000	
三菱瓦斯化学	99,900	2,053.50	205,144,650	
三井化学	110,200	3,835.00	422,617,000	
ＪＳＲ	124,900	4,051.00	505,969,900	
東京応化工業	21,300	9,323.00	198,579,900	
大阪有機化学工業	11,200	2,735.00	30,632,000	
三菱ケミカルグループ	902,300	920.40	830,476,920	
ＫＨネオケム	20,400	2,277.00	46,450,800	
ダイセル	186,200	1,230.00	229,026,000	
住友ベークライト	19,700	6,919.00	136,304,300	
積水化学工業	271,000	2,126.00	576,146,000	
日本ゼオン	80,100	1,569.50	125,716,950	
アイカ工業	33,800	3,401.00	114,953,800	
ＵＢＥ	68,900	2,386.50	164,429,850	
積水樹脂	18,600	2,431.00	45,216,600	
タキロンシーアイ	29,200	581.00	16,965,200	
旭有機材	8,900	3,810.00	33,909,000	
ニチバン	8,400	1,839.00	15,447,600	
リケンテクノス	28,800	728.00	20,966,400	
大倉工業	6,200	2,626.00	16,281,200	
積水化成品工業	18,700	453.00	8,471,100	
群栄化学工業	3,100	3,310.00	10,261,000	
タイガースポリマー	4,100	663.00	2,718,300	
ミライアル	2,700	1,435.00	3,874,500	
ダイキアクシス	3,800	728.00	2,766,400	
ダイキョーニシカワ	29,600	800.00	23,680,000	
竹本容器	3,300	798.00	2,633,400	
森六ホールディングス	6,800	2,277.00	15,483,600	
恵和	9,600	1,378.00	13,228,800	
日本化薬	102,200	1,280.50	130,867,100	
カーリットホールディングス	12,100	984.00	11,906,400	

ソルクシーズ	7,200	429.00	3,088,800	
ＣＬホールディングス	3,200	803.00	2,569,600	
プレステージ・インターナショナル	57,800	616.00	35,604,800	
フェイス	2,500	489.00	1,222,500	
プロトコーポレーション	16,700	1,118.00	18,670,600	
ハイマックス	4,200	1,441.00	6,052,200	
アミューズ	7,400	1,540.00	11,396,000	
野村総合研究所	266,700	3,995.00	1,065,466,500	
ドリームインキュベータ	4,200	3,000.00	12,600,000	
サイバネットシステム	9,600	775.00	7,440,000	
クイック	10,400	2,119.00	22,037,600	
ＴＡＣ	4,800	197.00	945,600	
ＣＥホールディングス	4,700	548.00	2,575,600	
日本システム技術	3,800	2,185.00	8,303,000	
電通グループ	134,900	4,448.00	600,035,200	
インテージホールディングス	15,100	2,211.00	33,386,100	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,600	960.00	3,456,000	
東邦システムサイエンス	3,800	1,241.00	4,715,800	
ぴあ	4,600	3,590.00	16,514,000	
イオンファンタジー	5,900	3,050.00	17,995,000	
ソースネクスト	68,100	178.00	12,121,800	
シーティーエス	15,100	693.00	10,464,300	
ネクシィーズグループ	2,800	895.00	2,506,000	
インフォコム	17,200	2,725.00	46,870,000	
メディカルシステムネットワーク	12,200	430.00	5,246,000	
日本精化	7,600	2,680.00	20,368,000	
扶桑化学工業	12,400	4,210.00	52,204,000	
トリケミカル研究所	17,900	3,350.00	59,965,000	
シンプレクス・ホールディングス	23,000	2,741.00	63,043,000	
ＨＥＲＯＺ	4,500	1,514.00	6,813,000	
ラクスル	32,100	1,218.00	39,097,800	
メルカリ	81,000	3,326.00	269,406,000	
ＩＰＳ	4,400	2,528.00	11,123,200	
ＦＩＧ	10,200	329.00	3,355,800	
システムサポート	5,200	2,004.00	10,420,800	
ＡＤＥＫＡ	46,600	2,665.00	124,189,000	
日油	41,300	6,047.00	249,741,100	
ミヨシ油脂	3,400	1,191.00	4,049,400	
新日本理化	12,300	224.00	2,755,200	
ハリマ化成グループ	6,200	816.00	5,059,200	
イーソル	9,600	734.00	7,046,400	
東海ソフト	1,400	1,199.00	1,678,600	
ウイングアーク１ｓｔ	13,800	2,606.00	35,962,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,600	1,423.00	5,122,800	
サーバーワークス	2,700	3,770.00	10,179,000	
東名	700	2,464.00	1,724,800	
ヴィッツ	900	1,029.00	926,100	
トビラシステムズ	2,500	920.00	2,300,000	
Ｓａｎｓａｎ	43,900	1,300.50	57,091,950	

Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,100	775.00	1,627,500	
ギフティ	11,700	1,410.00	16,497,000	
花王	302,300	5,416.00	1,637,256,800	
第一工業製薬	4,800	1,697.00	8,145,600	
石原ケミカル	6,100	1,592.00	9,711,200	
日華化学	3,600	913.00	3,286,800	
ニイタカ	1,700	2,100.00	3,570,000	
三洋化成工業	8,300	4,055.00	33,656,500	
メドレー	18,000	4,725.00	85,050,000	
ベース	4,600	4,330.00	19,918,000	
ＪＭＤＣ	22,000	5,538.00	121,836,000	
武田薬品工業	1,184,900	4,613.00	5,465,943,700	
アステラス製薬	1,264,700	2,041.00	2,581,252,700	
住友ファーマ	99,300	507.10	50,355,030	
塩野義製薬	168,700	6,857.00	1,156,775,900	
わかもと製薬	8,300	219.00	1,817,700	
日本新薬	31,600	6,155.00	194,498,000	
中外製薬	419,100	4,741.00	1,986,953,100	
科研製薬	23,000	3,466.00	79,718,000	
エーザイ	162,900	8,427.00	1,372,758,300	
理研ビタミン	11,400	2,181.00	24,863,400	
ロート製薬	129,700	3,663.00	475,091,100	
小野薬品工業	258,300	2,811.50	726,210,450	
久光製薬	29,800	5,058.00	150,728,400	
有機合成薬品工業	6,400	293.00	1,875,200	
持田製薬	15,500	3,340.00	51,770,000	
参天製薬	244,000	1,359.00	331,596,000	
扶桑薬品工業	4,300	1,960.00	8,428,000	
日本ケミファ	900	1,855.00	1,669,500	
ツムラ	42,100	2,720.00	114,512,000	
テルモ	410,500	3,885.00	1,594,792,500	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	40,200	2,500.00	100,500,000	
キッセイ薬品工業	19,600	3,350.00	65,660,000	
生化学工業	25,600	792.00	20,275,200	
栄研化学	21,700	1,437.00	31,182,900	
鳥居薬品	7,200	3,910.00	28,152,000	
ＪＣＲファーマ	45,300	1,272.50	57,644,250	
東和薬品	20,600	2,807.00	57,824,200	
富士製薬工業	9,900	1,190.00	11,781,000	
ゼリア新薬工業	18,600	2,114.00	39,320,400	
そーせいグループ	43,200	1,478.00	63,849,600	
第一三共	1,166,300	4,171.00	4,864,637,300	
杏林製薬	29,000	1,834.00	53,186,000	
大幸薬品	26,500	334.00	8,851,000	
ダイト	10,200	2,232.00	22,766,400	
大塚ホールディングス	278,500	5,282.00	1,471,037,000	
大正製薬ホールディングス	29,800	5,985.00	178,353,000	
ペプチドリーム	64,900	1,464.00	95,013,600	
大日本塗料	16,300	954.00	15,550,200	
日本ペイントホールディングス	710,000	1,022.00	725,620,000	

関西ペイント	107,200	2,167.50	232,356,000	
神東塗料	7,400	128.00	947,200	
中国塗料	21,900	1,370.00	30,003,000	
日本特殊塗料	5,600	1,297.00	7,263,200	
藤倉化成	18,000	448.00	8,064,000	
太陽ホールディングス	20,300	2,562.00	52,008,600	
ＤＩＣ	52,200	2,452.50	128,020,500	
サカタインクス	29,800	1,263.00	37,637,400	
東洋インキＳＣホールディングス	29,200	2,504.00	73,116,800	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	12,000	1,434.00	17,208,000	
アルプス技研	13,000	2,625.00	34,125,000	
サニックス	21,900	329.00	7,205,100	
日本空調サービス	14,800	775.00	11,470,000	
オリエンタルランド	726,300	4,882.00	3,545,796,600	
フォーカスシステムズ	9,700	977.00	9,476,900	
ダスキン	30,500	3,301.00	100,680,500	
パーク２４	85,400	1,797.50	153,506,500	
明光ネットワークジャパン	16,700	621.00	10,370,700	
ファルコホールディングス	6,200	1,971.00	12,220,200	
クレスコ	10,300	1,712.00	17,633,600	
フジ・メディア・ホールディングス	128,600	1,548.00	199,072,800	
秀英予備校	2,200	401.00	882,200	
田谷	1,600	465.00	744,000	
ラウンドワン	114,800	563.00	64,632,400	
リゾートトラスト	54,200	2,237.00	121,245,400	
オービック	44,700	23,020.00	1,028,994,000	
ジャストシステム	19,300	2,878.00	55,545,400	
ＴＤＣソフト	11,300	1,652.00	18,667,600	
ＬＩＮＥヤフー	1,905,300	414.10	788,984,730	
ビー・エム・エル	16,800	2,817.00	47,325,600	
トレンドマイクロ	63,200	5,838.00	368,961,600	
ＩＤホールディングス	9,000	1,444.00	12,996,000	
リソー教育	62,300	259.00	16,135,700	
日本オラクル	25,600	10,960.00	280,576,000	
早稲田アカデミー	7,600	1,427.00	10,845,200	
アルファシステムズ	4,300	2,897.00	12,457,100	
フューチャー	28,500	1,489.00	42,436,500	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,100	1,786.00	12,680,600	
ＳＢテクノロジー	5,600	2,202.00	12,331,200	
トーセ	2,500	728.00	1,820,000	
ユー・エス・エス	141,100	2,554.00	360,369,400	
オービックビジネスコンサルタント	26,400	6,320.00	166,848,000	
アイティフォー	17,700	1,102.00	19,505,400	
東京個別指導学院	16,200	498.00	8,067,600	
東計電算	1,800	6,190.00	11,142,000	
サイバーエージェント	303,100	795.20	241,025,120	
楽天グループ	1,174,200	601.70	706,516,140	
エックスネット	1,400	1,049.00	1,468,600	
クリーク・アンド・リバー社	8,000	2,052.00	16,416,000	

ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	22,400	560.00	12,544,000	
テー・オー・ダブリュー	27,300	313.00	8,544,900	
大塚商会	66,300	6,052.00	401,247,600	
サイボウズ	18,500	1,906.00	35,261,000	
山田コンサルティンググループ	7,000	1,577.00	11,039,000	
セントラルスポーツ	5,200	2,383.00	12,391,600	
パラカ	4,700	1,937.00	9,103,900	
電通国際情報サービス	16,200	5,410.00	87,642,000	
ＡＣＣＥＳＳ	15,900	788.00	12,529,200	
デジタルガレージ	23,700	3,320.00	78,684,000	
イーエムシステムズ	22,400	715.00	16,016,000	
ウェザーニューズ	4,200	6,000.00	25,200,000	
ＣＩＪ	22,400	547.00	12,252,800	
ビジネスエンジニアリング	1,900	3,375.00	6,412,500	
日本エンタープライズ	9,100	125.00	1,137,500	
WOWOW	10,100	1,097.00	11,079,700	
スカラ	12,400	765.00	9,486,000	
インテリジェント　ウェイブ	4,700	891.00	4,187,700	
フルキャストホールディングス	13,100	1,834.00	24,025,400	
エン・ジャパン	24,900	2,255.00	56,149,500	
あすか製薬ホールディングス	13,700	1,692.00	23,180,400	
サワイグループホールディングス	30,600	4,609.00	141,035,400	
富士フイルムホールディングス	256,800	9,008.00	2,313,254,400	
コニカミノルタ	301,100	467.60	140,794,360	
資生堂	279,500	5,106.00	1,427,127,000	
ライオン	175,100	1,412.00	247,241,200	
高砂香料工業	9,000	3,125.00	28,125,000	
マンダム	28,900	1,367.00	39,506,300	
ミルボン	18,200	4,151.00	75,548,200	
ファンケル	58,500	2,200.50	128,729,250	
コーセー	27,200	10,515.00	286,008,000	
コタ	12,300	1,627.00	20,012,100	
シーボン	1,300	1,532.00	1,991,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	68,600	1,746.50	119,809,900	
ノエビアホールディングス	12,000	5,240.00	62,880,000	
アジュバンホールディングス	2,100	930.00	1,953,000	
新日本製薬	7,600	1,511.00	11,483,600	
アクシージア	6,800	1,025.00	6,970,000	
エステー	10,300	1,502.00	15,470,600	
アグロ　カネショウ	5,300	1,356.00	7,186,800	
コニシ	22,400	2,300.00	51,520,000	
長谷川香料	25,600	3,240.00	82,944,000	
星光ＰＭＣ	5,400	1,068.00	5,767,200	
小林製薬	39,000	6,466.00	252,174,000	
荒川化学工業	11,300	1,022.00	11,548,600	
メック	11,100	4,070.00	45,177,000	
日本高純度化学	3,300	2,423.00	7,995,900	
タカラバイオ	36,000	1,347.00	48,492,000	
ＪＣＵ	14,900	3,125.00	46,562,500	

新田ゼラチン	5,400	694.00	3,747,600	
ＯＡＴアグリオ	3,300	1,818.00	5,999,400	
デクセリアルズ	36,600	3,883.00	142,117,800	
アース製薬	12,200	5,050.00	61,610,000	
北興化学工業	13,500	959.00	12,946,500	
大成ラミック	4,300	3,075.00	13,222,500	
クミアイ化学工業	53,200	1,135.00	60,382,000	
日本農薬	24,600	662.00	16,285,200	
富士興産	2,100	1,794.00	3,767,400	
ニチレキ	15,900	2,029.00	32,261,100	
ユシロ化学工業	7,000	1,535.00	10,745,000	
ビーピー・カストロール	3,400	901.00	3,063,400	
富士石油	27,300	316.00	8,626,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,900	1,187.00	3,442,300	
出光興産	148,700	3,349.00	497,996,300	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,271,100	551.70	1,252,965,870	
コスモエネルギーホールディングス	53,000	5,272.00	279,416,000	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	4,700	3,600.00	16,920,000	
テスホールディングス	28,200	499.00	14,071,800	
インフロニア・ホールディングス	137,200	1,559.00	213,894,800	
横浜ゴム	67,700	3,010.00	203,777,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	76,900	2,312.50	177,831,250	
ブリヂストン	391,900	6,063.00	2,376,089,700	
住友ゴム工業	131,300	1,617.00	212,312,100	
藤倉コンポジット	6,300	1,238.00	7,799,400	
オカモト	7,200	5,350.00	38,520,000	
アキレス	8,500	1,497.00	12,724,500	
フコク	7,000	1,422.00	9,954,000	
ニッタ	13,600	3,535.00	48,076,000	
クリエートメディック	2,900	907.00	2,630,300	
住友理工	26,000	1,070.00	27,820,000	
三ツ星ベルト	19,400	4,580.00	88,852,000	
バンドー化学	19,900	1,617.00	32,178,300	
ＡＧＣ	125,000	5,186.00	648,250,000	
日本板硝子	68,200	737.00	50,263,400	
石塚硝子	1,500	2,519.00	3,778,500	
有沢製作所	21,800	1,078.00	23,500,400	
日本山村硝子	3,300	1,632.00	5,385,600	
日本電気硝子	54,700	2,796.00	152,941,200	
オハラ	6,400	1,400.00	8,960,000	
住友大阪セメント	18,900	3,632.00	68,644,800	
太平洋セメント	85,300	2,619.00	223,400,700	
リソルホールディングス	800	4,850.00	3,880,000	
日本ヒューム	11,700	870.00	10,179,000	
日本コンクリート工業	25,800	317.00	8,178,600	
三谷セキサン	5,500	4,500.00	24,750,000	
アジアパイルホールディングス	20,900	665.00	13,898,500	
東海カーボン	123,500	1,198.00	147,953,000	
日本カーボン	7,100	4,580.00	32,518,000	
東洋炭素	9,400	5,700.00	53,580,000	

ノリタケカンパニーリミテド	6,700	6,030.00	40,401,000	
ＴＯＴＯ	88,400	3,807.00	336,538,800	
日本碍子	155,700	1,962.50	305,561,250	
日本特殊陶業	101,900	3,333.00	339,632,700	
ダントーホールディングス	5,900	769.00	4,537,100	
ＭＡＲＵＷＡ	5,000	24,380.00	121,900,000	
品川リフラクトリーズ	19,000	1,540.00	29,260,000	
黒崎播磨	2,700	9,350.00	25,245,000	
ヨータイ	7,200	1,498.00	10,785,600	
東京窯業	8,300	336.00	2,788,800	
ニッカトー	4,100	623.00	2,554,300	
フジミインコーポレーテッド	32,000	3,290.00	105,280,000	
クニミネ工業	2,600	1,010.00	2,626,000	
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,122.00	1,907,400	
ニチアス	33,900	3,080.00	104,412,000	
日本製鉄	616,800	3,268.00	2,015,702,400	
神戸製鋼所	277,000	1,882.50	521,452,500	
中山製鋼所	28,400	867.00	24,622,800	
合同製鐵	6,900	4,440.00	30,636,000	
ＪＦＥホールディングス	383,000	2,158.00	826,514,000	
東京製鐵	38,800	1,688.00	65,494,400	
共英製鋼	15,800	1,956.00	30,904,800	
大和工業	22,800	7,224.00	164,707,200	
東京鐵鋼	6,600	3,445.00	22,737,000	
大阪製鐵	6,400	1,743.00	11,155,200	
淀川製鋼所	15,800	3,610.00	57,038,000	
中部鋼鈑	11,400	2,098.00	23,917,200	
丸一鋼管	42,000	3,778.00	158,676,000	
モリ工業	2,100	3,925.00	8,242,500	
大同特殊鋼	17,300	6,113.00	105,754,900	
日本高周波鋼業	3,200	572.00	1,830,400	
日本冶金工業	10,000	4,380.00	43,800,000	
山陽特殊製鋼	13,600	2,836.00	38,569,600	
愛知製鋼	7,900	3,950.00	31,205,000	
日本金属	2,000	879.00	1,758,000	
ミガロホールディングス	1,100	1,221.00	1,343,100	
大平洋金属	9,700	1,308.00	12,687,600	
新日本電工	68,600	294.00	20,168,400	
栗本鐵工所	6,600	2,775.00	18,315,000	
虹　技	1,100	1,471.00	1,618,100	
日本鋳鉄管	900	1,077.00	969,300	
日本製鋼所	37,100	2,746.00	101,876,600	
三菱製鋼	8,700	1,451.00	12,623,700	
日亜鋼業	9,500	289.00	2,745,500	
日本精線	1,900	4,810.00	9,139,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,300	660.00	4,158,000	
大紀アルミニウム工業所	19,500	1,247.00	24,316,500	
日本軽金属ホールディングス	37,200	1,616.00	60,115,200	
三井金属鉱業	40,100	3,811.00	152,821,100	
東邦亜鉛	8,100	1,643.00	13,308,300	

三菱マテリアル	91,900	2,440.50	224,281,950	
住友金属鉱山	159,800	4,322.00	690,655,600	
ＤＯＷＡホールディングス	30,900	4,733.00	146,249,700	
古河機械金属	20,300	1,826.00	37,067,800	
エス・サイエンス	55,400	23.00	1,274,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,200	3,275.00	66,155,000	
東邦チタニウム	25,000	1,906.00	47,650,000	
ＵＡＣＪ	19,300	3,135.00	60,505,500	
ＣＫサンエツ	2,600	3,575.00	9,295,000	
古河電気工業	45,900	2,338.50	107,337,150	
住友電気工業	475,500	1,722.00	818,811,000	
フジクラ	147,600	1,212.00	178,891,200	
ＳＷＣＣ	15,500	2,085.00	32,317,500	
タツタ電線	27,900	699.00	19,502,100	
カナレ電気	1,700	1,442.00	2,451,400	
平河ヒューテック	7,900	1,449.00	11,447,100	
いよぎんホールディングス	156,400	1,112.00	173,916,800	
しずおかフィナンシャルグループ	292,000	1,278.00	373,176,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	110,600	1,138.00	125,862,800	
楽天銀行	45,800	2,349.00	107,584,200	
京都フィナンシャルグループ	42,800	8,441.00	361,274,800	
リョービ	14,600	2,930.00	42,778,000	
アーレスティ	10,100	775.00	7,827,500	
ＡＲＥホールディングス	55,700	1,892.00	105,384,400	
東洋製罐グループホールディングス	82,200	2,529.00	207,883,800	
ホッカンホールディングス	7,400	1,489.00	11,018,600	
コロナ	7,800	925.00	7,215,000	
横河ブリッジホールディングス	17,200	2,746.00	47,231,200	
駒井ハルテック	1,600	2,005.00	3,208,000	
高田機工	600	3,110.00	1,866,000	
三和ホールディングス	126,800	2,054.00	260,447,200	
文化シヤッター	39,700	1,169.00	46,409,300	
三協立山	15,800	868.00	13,714,400	
アルインコ	10,400	1,041.00	10,826,400	
東洋シヤッター	2,100	620.00	1,302,000	
ＬＩＸＩＬ	200,600	1,671.50	335,302,900	
日本フイルコン	6,000	478.00	2,868,000	
ノーリツ	22,900	1,591.00	36,433,900	
長府製作所	13,700	2,129.00	29,167,300	
リンナイ	74,900	2,828.50	211,854,650	
ユニプレス	23,900	1,127.00	26,935,300	
ダイニチ工業	4,500	730.00	3,285,000	
日東精工	20,000	590.00	11,800,000	
三洋工業	1,100	2,024.00	2,226,400	
岡部	24,700	745.00	18,401,500	
ジーテクト	15,400	1,821.00	28,043,400	
東プレ	24,200	1,681.00	40,680,200	
高周波熱錬	21,200	1,043.00	22,111,600	
東京製綱	8,100	1,408.00	11,404,800	
サンコール	8,100	491.00	3,977,100	

モリテックスチール	6,800	300.00	2,040,000	
パイオラックス	19,000	2,270.00	43,130,000	
エイチワン	14,100	836.00	11,787,600	
日本発条	121,900	1,103.00	134,455,700	
中央発條	10,100	770.00	7,777,000	
アドバネクス	1,100	983.00	1,081,300	
三浦工業	56,300	3,129.00	176,162,700	
タクマ	41,400	1,553.00	64,294,200	
テクノプロ・ホールディングス	81,200	3,169.00	257,322,800	
アトラグループ	2,500	197.00	492,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,100	1,583.00	11,239,300	
ＫｅｅＰｅｒ技研	8,500	5,780.00	49,130,000	
ファーストロジック	2,400	520.00	1,248,000	
三機サービス	1,500	1,010.00	1,515,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	10,900	682.00	7,433,800	
デザインワン・ジャパン	2,400	164.00	393,600	
イー・ガーディアン	5,200	1,798.00	9,349,600	
リブセンス	4,200	296.00	1,243,200	
ジャパンマテリアル	42,000	2,548.00	107,016,000	
ベクトル	21,500	1,160.00	24,940,000	
ウチヤマホールディングス	3,900	352.00	1,372,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,500	1,157.00	13,305,500	
キャリアリンク	5,100	2,530.00	12,903,000	
ＩＢＪ	10,400	624.00	6,489,600	
アサンテ	6,800	1,592.00	10,825,600	
バリューＨＲ	12,000	1,246.00	14,952,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	11,100	2,710.00	30,081,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,900	1,015.00	4,973,500	
ＥＲＩホールディングス	2,300	1,766.00	4,061,800	
アビスト	1,500	3,160.00	4,740,000	
シグマクシス・ホールディングス	20,800	1,627.00	33,841,600	
ウィルグループ	11,500	1,103.00	12,684,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	9,300	141.00	1,311,300	
メドピア	12,100	1,053.00	12,741,300	
レアジョブ	1,800	993.00	1,787,400	
リクルートホールディングス	1,015,900	4,745.00	4,820,445,500	
エラン	18,200	776.00	14,123,200	
ツガミ	30,000	1,165.00	34,950,000	
オークマ	13,500	6,801.00	91,813,500	
芝浦機械	13,500	3,940.00	53,190,000	
アマダ	215,000	1,583.00	340,345,000	
アイダエンジニアリング	27,700	972.00	26,924,400	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	2,300	2,595.00	5,968,500	
ＦＵＪＩ	58,500	2,433.00	142,330,500	
牧野フライス製作所	14,900	6,670.00	99,383,000	
オーエスジー	59,300	1,812.00	107,451,600	
ダイジェット工業	900	917.00	825,300	
旭ダイヤモンド工業	37,600	907.00	34,103,200	

DMG森精機	81,700	2,693.50	220,058,950	
ソディック	32,900	790.00	25,991,000	
ディスコ	65,000	30,520.00	1,983,800,000	
日東工器	6,600	1,984.00	13,094,400	
日進工具	11,300	1,080.00	12,204,000	
パンチ工業	8,100	431.00	3,491,100	
冨士ダイス	4,200	660.00	2,772,000	
土木管理総合試験所	4,300	335.00	1,440,500	
日本郵政	1,651,200	1,253.00	2,068,953,600	
ベルシステム２４ホールディングス	18,400	1,459.00	26,845,600	
鎌倉新書	15,600	591.00	9,219,600	
ＳＭＮ	2,100	389.00	816,900	
一蔵	1,100	579.00	636,900	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,800	636.00	1,144,800	
エアトリ	10,000	1,898.00	18,980,000	
アトラエ	8,100	1,116.00	9,039,600	
ストライク	5,700	3,395.00	19,351,500	
ソラスト	37,700	600.00	22,620,000	
セラク	4,200	1,277.00	5,363,400	
インソース	29,800	947.00	28,220,600	
豊田自動織機	97,600	11,690.00	1,140,944,000	
豊和工業	4,900	775.00	3,797,500	
石川製作所	2,300	1,241.00	2,854,300	
リケンＮＰＲ	13,962	1,736.00	24,238,032	
東洋機械金属	6,200	701.00	4,346,200	
津田駒工業	1,700	435.00	739,500	
エンシュウ	1,900	777.00	1,476,300	
島精機製作所	21,400	1,717.00	36,743,800	
オプトラン	22,100	1,889.00	41,746,900	
ＮＣホールディングス	1,800	1,606.00	2,890,800	
イワキ	8,900	1,978.00	17,604,200	
フリュー	14,100	1,418.00	19,993,800	
ヤマシンフィルタ	32,200	331.00	10,658,200	
日阪製作所	13,100	973.00	12,746,300	
やまびこ	22,000	1,460.00	32,120,000	
野村マイクロ・サイエンス	4,600	6,420.00	29,532,000	
平田機工	6,400	7,620.00	48,768,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	14,900	612.00	9,118,800	
マルマエ	5,900	1,531.00	9,032,900	
タツモ	8,100	3,070.00	24,867,000	
ナブテスコ	84,600	2,807.50	237,514,500	
三井海洋開発	17,000	1,766.00	30,022,000	
レオン自動機	14,200	1,350.00	19,170,000	
ＳＭＣ	43,800	72,900.00	3,193,020,000	
ホソカワミクロン	8,700	4,105.00	35,713,500	
ユニオンツール	5,900	3,895.00	22,980,500	
瑞光	9,700	1,175.00	11,397,500	
オイレス工業	18,900	1,976.00	37,346,400	
日精エー・エス・ビー機械	5,300	4,680.00	24,804,000	
サトーホールディングス	19,200	2,112.00	40,550,400	

技研製作所	12,600	2,117.00	26,674,200	
日本エアーテック	6,300	1,351.00	8,511,300	
カワタ	2,600	1,072.00	2,787,200	
日精樹脂工業	10,000	1,054.00	10,540,000	
オカダアイヨン	2,700	2,056.00	5,551,200	
ワイエイシイホールディングス	3,800	2,582.00	9,811,600	
小松製作所	631,700	3,860.00	2,438,362,000	
住友重機械工業	79,700	3,690.00	294,093,000	
日立建機	53,700	4,422.00	237,461,400	
日工	19,900	661.00	13,153,900	
巴工業	5,300	2,989.00	15,841,700	
井関農機	12,500	1,153.00	14,412,500	
ＴＯＷＡ	13,700	5,070.00	69,459,000	
丸山製作所	1,600	2,168.00	3,468,800	
北川鉄工所	5,300	1,504.00	7,971,200	
シンニッタン	9,700	245.00	2,376,500	
ローツェ	7,000	10,940.00	76,580,000	
タカキタ	2,500	468.00	1,170,000	
クボタ	707,500	2,167.50	1,533,506,250	
荏原実業	7,100	2,640.00	18,744,000	
東洋エンジニアリング	17,200	616.00	10,595,200	
三菱化工機	4,400	2,757.00	12,130,800	
月島ホールディングス	18,300	1,312.00	24,009,600	
帝国電機製作所	9,400	2,549.00	23,960,600	
東京機械製作所	2,100	370.00	777,000	
新東工業	27,200	1,075.00	29,240,000	
澁谷工業	12,600	2,558.00	32,230,800	
アイチコーポレーション	18,800	969.00	18,217,200	
小森コーポレーション	31,200	1,057.00	32,978,400	
鶴見製作所	10,200	3,190.00	32,538,000	
日本ギア工業	2,900	370.00	1,073,000	
酒井重工業	1,500	5,530.00	8,295,000	
荏原製作所	55,300	7,092.00	392,187,600	
石井鐵工所	1,000	3,010.00	3,010,000	
酉島製作所	11,600	1,896.00	21,993,600	
北越工業	13,500	1,975.00	26,662,500	
ダイキン工業	160,900	23,760.00	3,822,984,000	
オルガノ	18,500	4,330.00	80,105,000	
トーヨーカネツ	5,100	3,390.00	17,289,000	
栗田工業	75,400	5,072.00	382,428,800	
椿本チエイン	19,100	3,965.00	75,731,500	
大同工業	3,600	776.00	2,793,600	
日機装	31,000	963.00	29,853,000	
木村化工機	10,200	719.00	7,333,800	
レイズネクスト	19,000	1,432.00	27,208,000	
アネスト岩田	23,000	1,182.00	27,186,000	
ダイフク	208,600	2,799.50	583,975,700	
サムコ	3,700	4,395.00	16,261,500	
加藤製作所	4,300	1,218.00	5,237,400	
油研工業	1,400	2,275.00	3,185,000	

タダノ	77,500	1,240.00	96,100,000	
フジテック	47,300	3,345.00	158,218,500	
ＣＫＤ	37,300	2,124.00	79,225,200	
平和	44,800	2,132.00	95,513,600	
理想科学工業	10,800	2,377.00	25,671,600	
ＳＡＮＫＹＯ	26,500	6,719.00	178,053,500	
日本金銭機械	14,800	1,014.00	15,007,200	
マースグループホールディングス	7,900	2,685.00	21,211,500	
フクシマガリレイ	9,900	4,900.00	48,510,000	
オーイズミ	3,300	400.00	1,320,000	
ダイコク電機	7,400	4,915.00	36,371,000	
竹内製作所	24,400	4,920.00	120,048,000	
アマノ	38,200	3,272.00	124,990,400	
ＪＵＫＩ	20,900	609.00	12,728,100	
サンデン	13,500	184.00	2,484,000	
ジャノメ	13,500	736.00	9,936,000	
ブラザー工業	180,100	2,415.00	434,941,500	
マックス	16,600	2,661.00	44,172,600	
モリタホールディングス	23,400	1,577.00	36,901,800	
グローリー	32,400	2,893.50	93,749,400	
新晃工業	13,600	2,249.00	30,586,400	
大和冷機工業	20,600	1,378.00	28,386,800	
セガサミーホールディングス	108,400	2,609.00	282,815,600	
ＴＰＲ	15,500	1,817.00	28,163,500	
ツバキ・ナカシマ	27,100	775.00	21,002,500	
ホシザキ	79,500	5,163.00	410,458,500	
大豊工業	11,700	836.00	9,781,200	
日本精工	224,600	859.70	193,088,620	
ＮＴＮ	265,800	284.00	75,487,200	
ジェイテクト	119,900	1,364.00	163,543,600	
不二越	9,900	3,865.00	38,263,500	
ミネベアミツミ	234,600	2,564.00	601,514,400	
日本トムソン	33,000	564.00	18,612,000	
ＴＨＫ	77,800	2,818.50	219,279,300	
ユーシン精機	10,700	688.00	7,361,600	
前澤給装工業	9,500	1,268.00	12,046,000	
イーグル工業	14,900	1,693.00	25,225,700	
前澤工業	5,100	969.00	4,941,900	
日本ピラー工業	12,400	3,960.00	49,104,000	
キッツ	45,100	1,055.00	47,580,500	
日立製作所	655,600	9,333.00	6,118,714,800	
東芝	259,400	4,608.00	1,195,315,200	
三菱電機	1,393,400	1,810.50	2,522,750,700	
富士電機	82,000	6,792.00	556,944,000	
東洋電機製造	2,900	984.00	2,853,600	
安川電機	159,800	5,642.00	901,591,600	
シンフォニア　テクノロジー	14,900	1,650.00	24,585,000	
明電舎	20,400	2,140.00	43,656,000	
オリジン	2,000	1,292.00	2,584,000	
山洋電気	5,700	6,670.00	38,019,000	

デンヨー	10,200	2,272.00	23,174,400	
ＰＨＣホールディングス	18,800	1,501.00	28,218,800	
ソシオネクスト	20,000	15,090.00	301,800,000	
ベイカレント・コンサルティング	108,600	5,024.00	545,606,400	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,900	988.00	2,865,200	
アイモバイル	6,100	1,350.00	8,235,000	
キャリアインデックス	3,100	279.00	864,900	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,900	1,145.00	3,320,500	
船場	1,500	873.00	1,309,500	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,900	2,150.00	105,135,000	
フルテック	1,400	1,189.00	1,664,600	
グリーンズ	3,000	1,578.00	4,734,000	
ツナググループ・ホールディングス	2,500	805.00	2,012,500	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	2,700	305.00	823,500	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,100	667.00	733,700	
ウェルビー	10,000	634.00	6,340,000	
エル・ティー・エス	1,700	3,570.00	6,069,000	
ミダックホールディングス	8,400	1,813.00	15,229,200	
キュービーネットホールディングス	6,500	1,627.00	10,575,500	
ＲＰＡホールディングス	18,600	330.00	6,138,000	
三櫻工業	20,300	949.00	19,264,700	
マキタ	167,800	3,894.00	653,413,200	
東芝テック	20,100	3,260.00	65,526,000	
芝浦メカトロニクス	7,000	7,630.00	53,410,000	
マブチモーター	33,500	4,548.00	152,358,000	
ニデック	328,000	7,003.00	2,296,984,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,800	470.00	4,606,000	
トレックス・セミコンダクター	6,300	2,130.00	13,419,000	
東光高岳	8,100	2,027.00	16,418,700	
ダブル・スコープ	38,600	1,049.00	40,491,400	
宮越ホールディングス	6,000	1,249.00	7,494,000	
ダイヘン	12,200	4,960.00	60,512,000	
ヤーマン	23,300	1,020.00	23,766,000	
ＪＶＣケンウッド	122,800	675.00	82,890,000	
ミマキエンジニアリング	12,700	776.00	9,855,200	
Ｉ－ＰＥＸ	9,300	1,547.00	14,387,100	
大崎電気工業	32,100	641.00	20,576,100	
オムロン	123,500	6,484.00	800,774,000	
日東工業	18,200	3,585.00	65,247,000	
ＩＤＥＣ	19,900	2,874.00	57,192,600	
正興電機製作所	2,900	1,187.00	3,442,300	
不二電機工業	1,800	1,106.00	1,990,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	44,200	2,577.00	113,903,400	
サクサホールディングス	1,800	2,448.00	4,406,400	
メルコホールディングス	3,300	3,235.00	10,675,500	
テクノメディカ	3,200	2,221.00	7,107,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,600	870.00	4,002,000	

日本電気	190,700	8,089.00	1,542,572,300	
富士通	134,400	17,390.00	2,337,216,000	
沖電気工業	61,000	1,008.00	61,488,000	
岩崎通信機	4,000	795.00	3,180,000	
電気興業	5,400	2,505.00	13,527,000	
サンケン電気	12,400	8,810.00	109,244,000	
ナカヨ	1,600	1,233.00	1,972,800	
アイホン	8,300	3,070.00	25,481,000	
ルネサスエレクトロニクス	879,900	2,372.00	2,087,122,800	
セイコーエプソン	173,000	2,366.00	409,318,000	
ワコム	102,500	589.00	60,372,500	
アルバック	32,100	5,660.00	181,686,000	
アクセル	3,300	1,838.00	6,065,400	
ＥＩＺＯ	9,800	5,020.00	49,196,000	
ジャパンディスプレイ	517,800	36.00	18,640,800	
日本信号	30,600	929.00	28,427,400	
京三製作所	28,200	489.00	13,789,800	
能美防災	18,300	1,799.00	32,921,700	
ホーチキ	10,000	1,663.00	16,630,000	
星和電機	4,000	491.00	1,964,000	
エレコム	32,300	1,737.00	56,105,100	
パナソニック　ホールディングス	1,592,500	1,653.50	2,633,198,750	
シャープ	162,300	962.90	156,278,670	
アンリツ	94,900	1,042.00	98,885,800	
富士通ゼネラル	38,100	2,762.50	105,251,250	
ソニーグループ	944,200	13,105.00	12,373,741,000	
ＴＤＫ	213,500	5,782.00	1,234,457,000	
帝国通信工業	6,100	1,855.00	11,315,500	
タムラ製作所	57,900	535.00	30,976,500	
アルプスアルパイン	120,500	1,283.50	154,661,750	
池上通信機	2,800	873.00	2,444,400	
日本電波工業	16,100	1,329.00	21,396,900	
鈴木	7,200	1,208.00	8,697,600	
メイコー	14,700	3,375.00	49,612,500	
日本トリム	3,000	2,989.00	8,967,000	
ローランド　ディー．ジー．	7,400	3,440.00	25,456,000	
フォスター電機	12,400	1,009.00	12,511,600	
ＳＭＫ	3,200	2,463.00	7,881,600	
ヨコオ	10,800	1,456.00	15,724,800	
ティアック	13,900	111.00	1,542,900	
ホシデン	31,500	1,865.00	58,747,500	
ヒロセ電機	21,700	17,505.00	379,858,500	
日本航空電子工業	27,600	2,979.00	82,220,400	
ＴＯＡ	15,400	1,105.00	17,017,000	
マクセル	27,300	1,682.00	45,918,600	
古野電気	17,400	1,356.00	23,594,400	
スミダコーポレーション	18,100	1,376.00	24,905,600	
アイコム	5,200	3,395.00	17,654,000	
リオン	5,500	2,386.00	13,123,000	
横河電機	147,400	2,839.00	418,468,600	

新電元工業	5,200	3,055.00	15,886,000	
アズビル	93,300	4,813.00	449,052,900	
東亜ディーケーケー	4,300	878.00	3,775,400	
日本光電工業	61,600	3,674.00	226,318,400	
チノー	5,500	2,074.00	11,407,000	
共和電業	8,400	383.00	3,217,200	
日本電子材料	8,800	1,447.00	12,733,600	
堀場製作所	25,500	8,084.00	206,142,000	
アドバンテスト	420,500	4,590.00	1,930,095,000	
小野測器	3,700	451.00	1,668,700	
エスペック	10,700	2,333.00	24,963,100	
キーエンス	133,500	57,150.00	7,629,525,000	
日置電機	6,300	7,340.00	46,242,000	
シスメックス	115,100	7,386.00	850,128,600	
日本マイクロニクス	23,900	2,210.00	52,819,000	
メガチップス	10,500	4,145.00	43,522,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,300	3,850.00	28,105,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	11,200	618.00	6,921,600	
澤藤電機	1,000	1,255.00	1,255,000	
デンソー	1,101,200	2,449.00	2,696,838,800	
原田工業	3,900	823.00	3,209,700	
コーセル	16,000	1,182.00	18,912,000	
イリソ電子工業	12,300	3,990.00	49,077,000	
オプテックスグループ	24,400	1,581.00	38,576,400	
千代田インテグレ	5,300	2,831.00	15,004,300	
レーザーテック	61,200	27,255.00	1,668,006,000	
スタンレー電気	93,900	2,460.50	231,040,950	
ウシオ電機	67,800	1,951.50	132,311,700	
岡谷電機産業	6,900	292.00	2,014,800	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	8,300	400.00	3,320,000	
エノモト	2,200	1,697.00	3,733,400	
日本セラミック	10,900	2,747.00	29,942,300	
遠藤照明	4,000	1,236.00	4,944,000	
古河電池	9,700	962.00	9,331,400	
双信電機	3,600	334.00	1,202,400	
山一電機	10,900	1,774.00	19,336,600	
図研	11,600	3,770.00	43,732,000	
日本電子	33,500	4,866.00	163,011,000	
カシオ計算機	99,500	1,259.50	125,320,250	
ファナック	650,900	4,056.00	2,640,050,400	
日本シイエムケイ	28,300	697.00	19,725,100	
エンプラス	3,900	10,710.00	41,769,000	
大真空	16,200	778.00	12,603,600	
ローム	246,600	2,930.50	722,661,300	
浜松ホトニクス	107,100	6,383.00	683,619,300	
三井ハイテック	13,800	7,310.00	100,878,000	
新光電気工業	47,200	5,709.00	269,464,800	
京セラ	207,300	7,643.00	1,584,393,900	
協栄産業	800	2,466.00	1,972,800	
太陽誘電	65,100	3,910.00	254,541,000	

村田製作所	1,214,500	2,775.50	3,370,844,750	
双葉電子工業	25,400	519.00	13,182,600	
日東電工	97,200	10,015.00	973,458,000	
北陸電気工業	3,300	1,406.00	4,639,800	
東海理化電機製作所	37,600	2,329.00	87,570,400	
ニチコン	27,300	1,346.00	36,745,800	
日本ケミコン	13,200	1,368.00	18,057,600	
ＫＯＡ	20,200	1,798.00	36,319,600	
三井Ｅ＆Ｓ	64,500	463.00	29,863,500	
日立造船	110,400	844.00	93,177,600	
三菱重工業	235,700	8,407.00	1,981,529,900	
川崎重工業	100,600	3,708.00	373,024,800	
ＩＨＩ	84,900	3,044.00	258,435,600	
名村造船所	22,900	831.00	19,029,900	
サノヤスホールディングス	11,800	134.00	1,581,200	
スプリックス	2,600	824.00	2,142,400	
マネジメントソリューションズ	5,900	2,600.00	15,340,000	
プロレド・パートナーズ	3,300	439.00	1,448,700	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	2,700	361.00	974,700	
テノ．ホールディングス	1,100	556.00	611,600	
フロンティア・マネジメント	3,400	1,456.00	4,950,400	
ピアラ	1,800	417.00	750,600	
コプロ・ホールディングス	3,100	1,259.00	3,902,900	
ギークス	1,300	679.00	882,700	
アンビスホールディングス	14,700	2,765.00	40,645,500	
カーブスホールディングス	37,500	716.00	26,850,000	
フォーラムエンジニアリング	8,000	1,292.00	10,336,000	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	4,700	1,281.00	6,020,700	
日本車輌製造	5,200	2,036.00	10,587,200	
三菱ロジスネクスト	21,300	1,285.00	27,370,500	
近畿車輌	1,300	1,979.00	2,572,700	
一家ホールディングス	2,100	659.00	1,383,900	
フルサト・マルカホールディングス	12,700	2,789.00	35,420,300	
ヤマエグループホールディングス	8,000	3,545.00	28,360,000	
ジャパンクラフトホールディングス	5,300	222.00	1,176,600	
ＦＰＧ	44,400	1,319.00	58,563,600	
島根銀行	3,100	525.00	1,627,500	
じもとホールディングス	7,900	418.00	3,302,200	
全国保証	34,400	4,992.00	171,724,800	
めぶきフィナンシャルグループ	652,100	432.80	282,228,880	
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,800	1,741.00	18,802,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,800	4,655.00	78,204,000	
九州フィナンシャルグループ	231,200	877.00	202,762,400	
かんぽ生命保険	153,100	2,688.50	411,609,350	
ゆうちょ銀行	361,200	1,322.00	477,506,400	
あんしん保証	4,400	278.00	1,223,200	
富山第一銀行	41,700	997.00	41,574,900	

コンコルディア・フィナンシャルグループ	705,500	714.20	503,868,100	
ジェイリース	2,900	1,964.00	5,695,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	81,600	1,794.00	146,390,400	
イントラスト	3,300	916.00	3,022,800	
日本モーゲージサービス	4,900	546.00	2,675,400	
ＣＡＳＡ	3,400	837.00	2,845,800	
アルヒ	16,200	855.00	13,851,000	
プレミアグループ	22,100	1,489.00	32,906,900	
日産自動車	1,896,200	639.50	1,212,619,900	
いすゞ自動車	388,100	1,837.50	713,133,750	
トヨタ自動車	7,329,700	2,740.00	20,083,378,000	
日野自動車	172,100	566.30	97,460,230	
三菱自動車工業	520,800	582.80	303,522,240	
エフテック	6,200	787.00	4,879,400	
レシップホールディングス	3,700	524.00	1,938,800	
ＧＭＢ	1,800	1,915.00	3,447,000	
ファルテック	1,400	566.00	792,400	
武蔵精密工業	32,600	1,581.00	51,540,600	
日産車体	23,500	798.00	18,753,000	
新明和工業	41,900	1,260.00	52,794,000	
極東開発工業	22,000	1,809.00	39,798,000	
トピー工業	10,800	2,507.00	27,075,600	
ティラド	3,300	2,127.00	7,019,100	
曙ブレーキ工業	81,300	133.00	10,812,900	
タチエス	21,100	1,658.00	34,983,800	
ＮＯＫ	51,800	1,953.00	101,165,400	
フタバ産業	35,700	749.00	26,739,300	
カヤバ	12,900	4,665.00	60,178,500	
市光工業	24,000	557.00	13,368,000	
大同メタル工業	26,100	542.00	14,146,200	
プレス工業	59,600	688.00	41,004,800	
ミクニ	10,100	459.00	4,635,900	
太平洋工業	30,600	1,422.00	43,513,200	
河西工業	11,800	224.00	2,643,200	
アイシン	103,000	5,599.00	576,697,000	
マツダ	441,600	1,636.50	722,678,400	
今仙電機製作所	5,500	612.00	3,366,000	
本田技研工業	3,255,300	1,717.50	5,590,977,750	
スズキ	245,200	6,050.00	1,483,460,000	
ＳＵＢＡＲＵ	422,400	2,862.00	1,208,908,800	
安永	3,900	796.00	3,104,400	
ヤマハ発動機	192,400	3,968.00	763,443,200	
小糸製作所	160,600	2,360.50	379,096,300	
ＴＢＫ	8,800	411.00	3,616,800	
エクセディ	21,800	2,586.00	56,374,800	
ミツバ	25,100	714.00	17,921,400	
豊田合成	39,000	3,169.00	123,591,000	
愛三工業	22,000	1,239.00	27,258,000	

盟和産業	1,300	999.00	1,298,700	
日本プラスト	7,000	466.00	3,262,000	
ヨロズ	12,400	946.00	11,730,400	
エフ・シー・シー	23,600	1,833.00	43,258,800	
新家工業	2,000	3,065.00	6,130,000	
シマノ	54,200	21,045.00	1,140,639,000	
テイ・エス　テック	61,100	1,712.50	104,633,750	
三十三フィナンシャルグループ	11,800	1,862.00	21,971,600	
第四北越フィナンシャルグループ	20,600	3,910.00	80,546,000	
ひろぎんホールディングス	171,500	959.40	164,537,100	
マーキュリアホールディングス	4,600	780.00	3,588,000	
おきなわフィナンシャルグループ	12,100	2,510.00	30,371,000	
ダイレクトマーケティングミックス	14,100	472.00	6,655,200	
ポピンズ	2,000	1,212.00	2,424,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	10,700	2,027.00	21,688,900	
コンフィデンス・インターワークス	500	1,531.00	765,500	
十六フィナンシャルグループ	17,000	3,935.00	66,895,000	
北國フィナンシャルホールディングス	13,800	5,450.00	75,210,000	
ネットプロテクションズホールディングス	43,600	313.00	13,646,800	
プロクレアホールディングス	16,000	1,981.00	31,696,000	
あいちフィナンシャルグループ	18,400	2,459.00	45,245,600	
ジャムコ	4,900	1,590.00	7,791,000	
小野建	13,900	1,669.00	23,199,100	
はるやまホールディングス	4,100	518.00	2,123,800	
南陽	1,800	2,142.00	3,855,600	
ノジマ	46,100	1,357.00	62,557,700	
佐鳥電機	5,900	1,920.00	11,328,000	
カッパ・クリエイト	22,300	1,522.00	33,940,600	
エコートレーディング	1,800	1,437.00	2,586,600	
伯東	8,100	5,140.00	41,634,000	
コンドーテック	10,900	1,152.00	12,556,800	
中山福	5,000	352.00	1,760,000	
ライトオン	7,100	468.00	3,322,800	
ナガイレーベン	17,900	2,027.00	36,283,300	
三菱食品	13,000	3,955.00	51,415,000	
良品計画	154,100	1,789.50	275,761,950	
パリミキホールディングス	11,800	361.00	4,259,800	
松田産業	10,800	2,429.00	26,233,200	
第一興商	54,700	2,339.50	127,970,650	
メディパルホールディングス	135,100	2,551.50	344,707,650	
アドヴァングループ	13,400	1,033.00	13,842,200	
ＳＰＫ	6,300	1,887.00	11,888,100	
萩原電気ホールディングス	5,600	4,230.00	23,688,000	
アルビス	4,600	2,401.00	11,044,600	
アズワン	20,100	5,193.00	104,379,300	
スズデン	5,000	2,192.00	10,960,000	
尾家産業	2,200	2,070.00	4,554,000	
シモジマ	9,600	1,159.00	11,126,400	
ドウシシャ	14,900	2,193.00	32,675,700	

小津産業	2,100	1,580.00	3,318,000	
コナカ	10,200	391.00	3,988,200	
高速	7,300	2,102.00	15,344,600	
ハウス　オブ　ローゼ	1,300	1,605.00	2,086,500	
Ｇ－７ホールディングス	17,600	1,211.00	21,313,600	
たけびし	5,300	1,825.00	9,672,500	
イオン北海道	20,900	885.00	18,496,500	
コジマ	23,300	652.00	15,191,600	
ヒマラヤ	2,900	923.00	2,676,700	
コーナン商事	19,100	3,990.00	76,209,000	
ネットワンシステムズ	49,800	2,847.00	141,780,600	
エコス	5,300	2,145.00	11,368,500	
ワタミ	17,000	1,125.00	19,125,000	
マルシェ	3,200	266.00	851,200	
リックス	1,900	3,035.00	5,766,500	
システムソフト	46,400	71.00	3,294,400	
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	285,100	3,008.00	857,580,800	
丸文	12,500	1,188.00	14,850,000	
西松屋チェーン	31,200	1,622.00	50,606,400	
ゼンショーホールディングス	77,300	7,182.00	555,168,600	
ハピネット	12,000	2,412.00	28,944,000	
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,063.00	9,673,300	
ハークスレイ	3,200	701.00	2,243,200	
橋本総業ホールディングス	5,500	1,196.00	6,578,000	
日本ライフライン	41,400	1,163.00	48,148,200	
サイゼリヤ	20,900	5,530.00	115,577,000	
タカショー	12,300	616.00	7,576,800	
ＶＴホールディングス	53,600	505.00	27,068,000	
アルゴグラフィックス	12,300	3,265.00	40,159,500	
魚力	4,400	2,164.00	9,521,600	
ＩＤＯＭ	42,700	723.00	30,872,100	
日本エム・ディ・エム	7,900	741.00	5,853,900	
ポプラ	2,400	215.00	516,000	
フジ・コーポレーション	7,000	1,893.00	13,251,000	
ユナイテッドアローズ	15,100	1,933.00	29,188,300	
進和	8,700	2,424.00	21,088,800	
エスケイジャパン	2,200	681.00	1,498,200	
ダイトロン	5,500	3,070.00	16,885,000	
ハイデイ日高	20,900	2,665.00	55,698,500	
シークス	20,100	1,490.00	29,949,000	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,500	167.00	918,500	
コロワイド	65,100	2,325.50	151,390,050	
田中商事	2,600	686.00	1,783,600	
オーハシテクニカ	6,800	1,659.00	11,281,200	
壱番屋	11,200	5,220.00	58,464,000	
白銅	5,200	2,217.00	11,528,400	
トップカルチャー	3,000	188.00	564,000	
ＰＬＡＮＴ	2,100	790.00	1,659,000	

スギホールディングス	28,400	5,948.00	168,923,200	
ダイコー通産	900	1,163.00	1,046,700	
薬王堂ホールディングス	7,900	2,832.00	22,372,800	
島津製作所	162,600	3,935.00	639,831,000	
ＪＭＳ	12,300	528.00	6,494,400	
クボテック	2,000	252.00	504,000	
長野計器	9,700	2,465.00	23,910,500	
ブイ・テクノロジー	6,500	2,077.00	13,500,500	
スター精密	25,500	1,928.00	49,164,000	
東京計器	10,200	1,461.00	14,902,200	
愛知時計電機	5,300	1,886.00	9,995,800	
インターアクション	6,300	986.00	6,211,800	
オーバル	7,800	421.00	3,283,800	
東京精密	29,400	7,950.00	233,730,000	
マニー	53,400	1,865.00	99,591,000	
ニコン	193,000	1,582.00	305,326,000	
トプコン	70,200	1,739.00	122,077,800	
オリンパス	821,700	1,970.00	1,618,749,000	
理研計器	8,300	6,190.00	51,377,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	45,700	7,623.00	348,371,100	
キヤノン電子	14,800	1,882.00	27,853,600	
タムロン	8,300	4,595.00	38,138,500	
ＨＯＹＡ	282,800	15,590.00	4,408,852,000	
シード	4,500	838.00	3,771,000	
ノーリツ鋼機	12,600	3,235.00	40,761,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	19,400	1,698.00	32,941,200	
朝日インテック	149,200	2,683.00	400,303,600	
キヤノン	665,800	3,653.00	2,432,167,400	
リコー	334,700	1,289.50	431,595,650	
シチズン時計	122,800	915.00	112,362,000	
リズム	2,700	2,322.00	6,269,400	
大研医器	6,600	532.00	3,511,200	
メニコン	45,900	1,855.50	85,167,450	
シンシア	1,000	551.00	551,000	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	13,300	181.00	2,407,300	
中本パックス	2,700	1,654.00	4,465,800	
スノーピーク	19,100	1,183.00	22,595,300	
パラマウントベッドホールディングス	30,800	2,391.00	73,642,800	
トランザクション	8,800	1,749.00	15,391,200	
粧美堂	2,400	473.00	1,135,200	
ニホンフラッシュ	12,400	878.00	10,887,200	
前田工繊	11,300	2,981.00	33,685,300	
永大産業	9,300	220.00	2,046,000	
アートネイチャー	13,800	804.00	11,095,200	
バンダイナムコホールディングス	365,700	3,068.00	1,121,967,600	
アイフィスジャパン	2,500	606.00	1,515,000	
ＳＨＯＥＩ	30,100	2,281.00	68,658,100	
フランスベッドホールディングス	15,400	1,190.00	18,326,000	
マーベラス	21,600	701.00	15,141,600	
パイロットコーポレーション	18,800	5,233.00	98,380,400	

萩原工業	8,900	1,753.00	15,601,700	
エイベックス	22,800	1,376.00	31,372,800	
フジシールインターナショナル	27,000	1,730.00	46,710,000	
タカラトミー	60,700	2,084.00	126,498,800	
広済堂ホールディングス	6,000	3,035.00	18,210,000	
エステールホールディングス	2,100	622.00	1,306,200	
レック	19,100	959.00	18,316,900	
タカノ	3,200	842.00	2,694,400	
三光合成	16,800	697.00	11,709,600	
プロネクサス	11,100	1,192.00	13,231,200	
ホクシン	6,600	129.00	851,400	
ウッドワン	2,900	1,061.00	3,076,900	
きもと	13,100	186.00	2,436,600	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	164,100	3,433.00	563,355,300	
大日本印刷	145,900	3,961.00	577,909,900	
共同印刷	3,800	3,065.00	11,647,000	
ＮＩＳＳＨＡ	22,900	1,674.00	38,334,600	
光村印刷	600	1,280.00	768,000	
藤森工業	10,600	3,845.00	40,757,000	
ヴィア・ホールディングス	14,800	103.00	1,524,400	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,600	2,354.00	20,244,400	
前澤化成工業	8,700	1,524.00	13,258,800	
未来工業	4,800	3,645.00	17,496,000	
アシックス	113,800	4,871.00	554,319,800	
ツツミ	2,300	2,392.00	5,501,600	
ウェーブロックホールディングス	2,500	622.00	1,555,000	
ＪＳＰ	9,400	1,979.00	18,602,600	
ニチハ	16,700	2,985.00	49,849,500	
ローランド	9,800	4,250.00	41,650,000	
エフピコ	25,400	2,601.00	66,065,400	
小松ウオール工業	4,900	2,886.00	14,141,400	
ヤマハ	84,100	4,165.00	350,276,500	
河合楽器製作所	3,600	4,005.00	14,418,000	
クリナップ	14,900	706.00	10,519,400	
ピジョン	85,100	1,640.50	139,606,550	
天馬	11,000	2,476.00	27,236,000	
キングジム	11,800	892.00	10,525,600	
象印マホービン	36,300	1,591.00	57,753,300	
リンテック	26,800	2,507.50	67,201,000	
信越ポリマー	24,800	1,365.00	33,852,000	
東リ	20,100	359.00	7,215,900	
イトーキ	27,400	1,542.00	42,250,800	
任天堂	842,800	6,350.00	5,351,780,000	
三菱鉛筆	19,000	1,892.00	35,948,000	
松風	6,000	2,188.00	13,128,000	
タカラスタンダード	24,700	1,830.00	45,201,000	
コクヨ	54,600	2,393.50	130,685,100	
ナカバヤシ	14,300	517.00	7,393,100	
ニフコ	48,300	4,023.00	194,310,900	
立川ブラインド工業	6,200	1,397.00	8,661,400	

グローブライド	10,800	1,962.00	21,189,600	
オカムラ	40,200	2,232.00	89,726,400	
バルカー	11,200	4,140.00	46,368,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,300	1,987.00	2,583,100	
伊藤忠商事	870,300	5,482.00	4,770,984,600	
丸紅	1,093,200	2,319.00	2,535,130,800	
スクロール	20,900	1,066.00	22,279,400	
高島	6,200	918.00	5,691,600	
ヨンドシーホールディングス	12,100	1,855.00	22,445,500	
三陽商会	3,400	2,610.00	8,874,000	
長瀬産業	64,800	2,326.50	150,757,200	
ナイガイ	3,000	276.00	828,000	
蝶理	7,600	2,952.00	22,435,200	
豊田通商	123,700	8,558.00	1,058,624,600	
オンワードホールディングス	86,600	470.00	40,702,000	
三共生興	19,600	813.00	15,934,800	
兼松	54,800	2,032.00	111,353,600	
美津濃	13,300	4,675.00	62,177,500	
ツカモトコーポレーション	1,400	1,289.00	1,804,600	
ルックホールディングス	2,700	1,996.00	5,389,200	
三井物産	988,000	5,430.00	5,364,840,000	
日本紙パルプ商事	7,500	4,790.00	35,925,000	
東京エレクトロン	282,500	21,165.00	5,979,112,500	
カメイ	15,000	1,435.00	21,525,000	
東都水産	500	6,340.00	3,170,000	
ＯＵＧホールディングス	1,500	2,354.00	3,531,000	
スターゼン	10,800	2,505.00	27,054,000	
セイコーグループ	20,700	2,496.00	51,667,200	
山善	38,000	1,208.00	45,904,000	
椿本興業	2,200	4,910.00	10,802,000	
住友商事	854,600	3,033.00	2,592,001,800	
ＢＩＰＲＯＧＹ	49,200	3,736.00	183,811,200	
内田洋行	5,600	7,040.00	39,424,000	
三菱商事	861,100	7,240.00	6,234,364,000	
第一実業	14,900	1,850.00	27,565,000	
キヤノンマーケティングジャパン	32,800	3,898.00	127,854,400	
西華産業	5,500	2,237.00	12,303,500	
佐藤商事	9,900	1,465.00	14,503,500	
菱洋エレクトロ	12,100	3,370.00	40,777,000	
東京産業	12,900	845.00	10,900,500	
ユアサ商事	12,200	4,105.00	50,081,000	
神鋼商事	3,600	5,580.00	20,088,000	
トルク	5,200	302.00	1,570,400	
阪和興業	25,400	4,495.00	114,173,000	
正栄食品工業	9,400	4,630.00	43,522,000	
カナデン	9,400	1,332.00	12,520,800	
ＲＹＯＤＥＮ	11,500	2,392.00	27,508,000	
ニプロ	111,300	1,054.00	117,310,200	
岩谷産業	32,200	7,406.00	238,473,200	
ナイス	2,500	1,474.00	3,685,000	

ニチモウ	1,300	3,935.00	5,115,500	
極東貿易	8,500	1,847.00	15,699,500	
アステナホールディングス	26,500	483.00	12,799,500	
三愛オブリ	37,300	1,619.00	60,388,700	
稲畑産業	27,900	3,100.00	86,490,000	
ＧＳＩクレオス	8,300	2,122.00	17,612,600	
明和産業	18,800	652.00	12,257,600	
クワザワホールディングス	2,900	563.00	1,632,700	
キムラタン	52,900	19.00	1,005,100	
ゴールドウイン	23,600	10,180.00	240,248,000	
ユニ・チャーム	278,900	5,193.00	1,448,327,700	
デサント	23,000	4,330.00	99,590,000	
キング	4,000	656.00	2,624,000	
ワキタ	26,000	1,538.00	39,988,000	
ヤマトインターナショナル	7,300	307.00	2,241,100	
東邦ホールディングス	35,200	3,261.00	114,787,200	
サンゲツ	35,400	2,905.00	102,837,000	
ミツウロコグループホールディングス	18,100	1,296.00	23,457,600	
シナネンホールディングス	4,600	3,785.00	17,411,000	
伊藤忠エネクス	35,000	1,477.00	51,695,000	
サンリオ	40,000	7,410.00	296,400,000	
サンワ　テクノス	7,200	2,198.00	15,825,600	
リョーサン	15,000	4,750.00	71,250,000	
新光商事	19,000	1,205.00	22,895,000	
トーホー	6,100	3,280.00	20,008,000	
三信電気	5,600	2,146.00	12,017,600	
東陽テクニカ	14,300	1,296.00	18,532,800	
モスフードサービス	20,800	3,270.00	68,016,000	
加賀電子	11,500	6,670.00	76,705,000	
三益半導体工業	10,700	2,669.00	28,558,300	
都築電気	7,000	2,263.00	15,841,000	
ソーダニッカ	6,900	1,035.00	7,141,500	
立花エレテック	10,200	2,751.00	28,060,200	
木曽路	21,400	2,540.00	54,356,000	
ＳＲＳホールディングス	23,300	1,023.00	23,835,900	
千趣会	25,800	405.00	10,449,000	
タカキュー	6,700	82.00	549,400	
リテールパートナーズ	20,900	1,744.00	36,449,600	
ケーヨー	22,800	1,298.00	29,594,400	
上新電機	12,500	2,342.00	29,275,000	
日本瓦斯	74,800	2,267.00	169,571,600	
ロイヤルホールディングス	24,900	2,539.00	63,221,100	
東天紅	600	839.00	503,400	
いなげや	13,700	1,589.00	21,769,300	
チヨダ	13,500	916.00	12,366,000	
ライフコーポレーション	12,400	3,660.00	45,384,000	
リンガーハット	18,200	2,322.00	42,260,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	19,600	612.00	11,995,200	
テンアライド	11,000	300.00	3,300,000	
ＡＯＫＩホールディングス	26,000	1,000.00	26,000,000	

オークワ	22,600	841.00	19,006,600	
コメリ	21,700	3,110.00	67,487,000	
青山商事	30,100	1,592.00	47,919,200	
しまむら	16,500	15,340.00	253,110,000	
はせがわ	4,500	334.00	1,503,000	
高島屋	106,500	2,080.00	221,520,000	
松屋	23,900	907.00	21,677,300	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	68,700	1,701.00	116,858,700	
近鉄百貨店	6,100	2,873.00	17,525,300	
丸井グループ	104,300	2,445.00	255,013,500	
クレディセゾン	83,300	2,269.00	189,007,700	
アクシアル　リテイリング	9,600	3,775.00	36,240,000	
井筒屋	4,500	355.00	1,597,500	
イオン	478,900	3,079.00	1,474,533,100	
イズミ	21,400	3,880.00	83,032,000	
フォーバル	5,400	1,107.00	5,977,800	
平和堂	23,600	2,446.00	57,725,600	
フジ	21,600	1,801.00	38,901,600	
ヤオコー	15,900	7,627.00	121,269,300	
ゼビオホールディングス	19,200	985.00	18,912,000	
ケーズホールディングス	99,900	1,393.50	139,210,650	
ＰＡＬＴＡＣ	22,300	4,568.00	101,866,400	
三谷産業	24,700	317.00	7,829,900	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	3,400	511.00	1,737,400	
日産東京販売ホールディングス	12,000	469.00	5,628,000	
あおぞら銀行	82,800	2,902.50	240,327,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,233,600	1,263.00	10,399,036,800	
りそなホールディングス	1,650,900	837.00	1,381,803,300	
三井住友トラスト・ホールディングス	236,200	5,763.00	1,361,220,600	
三井住友フィナンシャルグループ	934,400	7,405.00	6,919,232,000	
千葉銀行	366,300	1,135.00	415,750,500	
群馬銀行	255,200	714.30	182,289,360	
武蔵野銀行	16,800	2,776.00	46,636,800	
千葉興業銀行	20,500	915.00	18,757,500	
筑波銀行	57,600	289.00	16,646,400	
七十七銀行	42,100	3,280.00	138,088,000	
秋田銀行	8,800	2,028.00	17,846,400	
山形銀行	14,600	1,169.00	17,067,400	
岩手銀行	8,900	2,637.00	23,469,300	
東邦銀行	103,300	286.00	29,543,800	
東北銀行	4,300	1,172.00	5,039,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	104,900	3,797.00	398,305,300	
スルガ銀行	115,900	637.00	73,828,300	
八十二銀行	277,600	831.00	230,685,600	
山梨中央銀行	13,500	1,771.00	23,908,500	
大垣共立銀行	25,000	2,071.00	51,775,000	
福井銀行	11,800	1,564.00	18,455,200	
清水銀行	5,300	1,624.00	8,607,200	
富山銀行	1,400	1,788.00	2,503,200	
滋賀銀行	21,800	3,820.00	83,276,000	

南都銀行	19,700	2,732.00	53,820,400	
百五銀行	123,600	551.00	68,103,600	
紀陽銀行	47,000	1,552.00	72,944,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	83,500	1,738.50	145,164,750	
山陰合同銀行	82,300	1,001.00	82,382,300	
鳥取銀行	2,800	1,341.00	3,754,800	
百十四銀行	12,000	2,681.00	32,172,000	
四国銀行	21,000	1,013.00	21,273,000	
阿波銀行	18,500	2,370.00	43,845,000	
大分銀行	7,900	2,788.00	22,025,200	
宮崎銀行	8,600	2,741.00	23,572,600	
佐賀銀行	7,700	2,023.00	15,577,100	
琉球銀行	30,200	1,201.00	36,270,200	
セブン銀行	471,000	306.30	144,267,300	
みずほフィナンシャルグループ	1,901,300	2,582.00	4,909,156,600	
高知銀行	2,900	1,030.00	2,987,000	
山口フィナンシャルグループ	129,000	1,314.00	169,506,000	
芙蓉総合リース	12,100	12,110.00	146,531,000	
みずほリース	19,500	4,885.00	95,257,500	
東京センチュリー	24,600	6,057.00	149,002,200	
ＳＢＩホールディングス	197,000	3,218.00	633,946,000	
日本証券金融	48,300	1,528.00	73,802,400	
アイフル	217,700	373.00	81,202,100	
日本アジア投資	7,000	256.00	1,792,000	
名古屋銀行	8,700	5,230.00	45,501,000	
北洋銀行	199,000	370.00	73,630,000	
大光銀行	2,600	1,396.00	3,629,600	
愛媛銀行	17,800	1,025.00	18,245,000	
トマト銀行	2,900	1,181.00	3,424,900	
京葉銀行	60,000	692.00	41,520,000	
栃木銀行	60,200	344.00	20,708,800	
北日本銀行	4,600	2,306.00	10,607,600	
東和銀行	24,300	667.00	16,208,100	
福島銀行	9,000	252.00	2,268,000	
大東銀行	3,400	756.00	2,570,400	
リコーリース	12,400	4,445.00	55,118,000	
イオンフィナンシャルサービス	75,500	1,229.00	92,789,500	
アコム	234,600	358.00	83,986,800	
ジャックス	14,000	5,100.00	71,400,000	
オリエントコーポレーション	34,300	1,120.00	38,416,000	
オリックス	863,100	2,796.00	2,413,227,600	
三菱ＨＣキャピタル	512,600	1,009.00	517,213,400	
ジャフコ　グループ	44,000	1,597.00	70,268,000	
九州リースサービス	4,100	1,032.00	4,231,200	
トモニホールディングス	105,900	487.00	51,573,300	
大和証券グループ本社	940,100	903.60	849,474,360	
野村ホールディングス	2,368,400	612.00	1,449,460,800	
岡三証券グループ	115,400	733.00	84,588,200	
丸三証券	43,800	817.00	35,784,600	
東洋証券	43,700	324.00	14,158,800	

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	143,200	502.00	71,886,400	
光世証券	1,900	589.00	1,119,100	
水戸証券	35,300	459.00	16,202,700	
いちよし証券	24,200	711.00	17,206,200	
松井証券	77,500	772.00	59,830,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	225,600	6,427.00	1,449,931,200	
日本取引所グループ	369,400	3,026.00	1,117,804,400	
マネックスグループ	141,700	639.00	90,546,300	
極東証券	16,300	979.00	15,957,700	
岩井コスモホールディングス	15,000	1,730.00	25,950,000	
アイザワ証券グループ	19,000	1,078.00	20,482,000	
フィデアホールディングス	13,600	1,626.00	22,113,600	
池田泉州ホールディングス	168,500	332.00	55,942,000	
アニコム　ホールディングス	44,600	568.00	25,332,800	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	267,500	5,706.00	1,526,355,000	
マネーパートナーズグループ	9,100	299.00	2,720,900	
スパークス・グループ	14,600	1,506.00	21,987,600	
小林洋行	2,800	236.00	660,800	
第一生命ホールディングス	642,300	3,203.00	2,057,286,900	
東京海上ホールディングス	1,299,500	3,495.00	4,541,752,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	4,200	444.00	1,864,800	
イー・ギャランティ	21,300	1,900.00	40,470,000	
アサックス	4,200	667.00	2,801,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	6,400	3,175.00	20,320,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	352,700	2,624.50	925,661,150	
アドバンスクリエイト	7,600	1,016.00	7,721,600	
三井不動産	561,000	3,432.00	1,925,352,000	
三菱地所	793,400	2,052.50	1,628,453,500	
平和不動産	21,300	4,070.00	86,691,000	
東京建物	114,900	2,097.00	240,945,300	
京阪神ビルディング	22,100	1,374.00	30,365,400	
住友不動産	237,700	3,830.00	910,391,000	
太平洋興発	3,300	788.00	2,600,400	
テーオーシー	23,700	646.00	15,310,200	
東京楽天地	2,100	4,170.00	8,757,000	
レオパレス２１	148,000	342.00	50,616,000	
スターツコーポレーション	18,900	2,942.00	55,603,800	
フジ住宅	18,400	704.00	12,953,600	
空港施設	15,900	562.00	8,935,800	
明和地所	4,200	1,180.00	4,956,000	
ゴールドクレスト	12,400	2,294.00	28,445,600	
リログループ	76,400	1,568.00	119,795,200	
エスリード	6,200	3,105.00	19,251,000	
日神グループホールディングス	21,100	538.00	11,351,800	
日本エスコン	24,600	911.00	22,410,600	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	66,300	477.00	31,625,100	
ＡＶＡＮＴＩＡ	5,000	838.00	4,190,000	
イオンモール	68,100	1,751.00	119,243,100	

毎日コムネット	3,200	760.00	2,432,000	
ファースト住建	3,600	1,202.00	4,327,200	
ランド	790,900	9.00	7,118,100	
カチタス	35,300	2,151.00	75,930,300	
東祥	9,500	1,066.00	10,127,000	
トーセイ	21,900	1,874.00	41,040,600	
穴吹興産	1,800	2,000.00	3,600,000	
サンフロンティア不動産	21,900	1,508.00	33,025,200	
ＦＪネクストホールディングス	13,900	1,060.00	14,734,000	
インテリックス	2,100	514.00	1,079,400	
ランドビジネス	3,200	311.00	995,200	
サンネクスタグループ	2,500	962.00	2,405,000	
グランディハウス	7,400	642.00	4,750,800	
東武鉄道	146,600	3,671.00	538,168,600	
相鉄ホールディングス	44,100	2,776.50	122,443,650	
東急	374,300	1,670.00	625,081,000	
京浜急行電鉄	151,400	1,244.00	188,341,600	
小田急電鉄	202,400	2,159.00	436,981,600	
京王電鉄	70,500	4,871.00	343,405,500	
京成電鉄	86,100	5,306.00	456,846,600	
富士急行	16,400	4,510.00	73,964,000	
東日本旅客鉄道	226,400	7,913.00	1,791,503,200	
西日本旅客鉄道	170,500	5,702.00	972,191,000	
東海旅客鉄道	514,000	3,374.00	1,734,236,000	
西武ホールディングス	161,400	1,407.50	227,170,500	
鴻池運輸	22,800	1,947.00	44,391,600	
西日本鉄道	35,600	2,433.00	86,614,800	
ハマキョウレックス	10,400	3,925.00	40,820,000	
サカイ引越センター	12,600	2,527.00	31,840,200	
近鉄グループホールディングス	133,200	4,178.00	556,509,600	
阪急阪神ホールディングス	177,700	4,737.00	841,764,900	
南海電気鉄道	63,700	2,844.00	181,162,800	
京阪ホールディングス	73,500	3,671.00	269,818,500	
神戸電鉄	3,700	2,828.00	10,463,600	
名古屋鉄道	147,200	2,119.50	311,990,400	
山陽電気鉄道	10,000	2,092.00	20,920,000	
アルプス物流	10,700	1,630.00	17,441,000	
トランコム	3,900	7,250.00	28,275,000	
ヤマトホールディングス	170,700	2,439.50	416,422,650	
山九	33,900	5,239.00	177,602,100	
日新	10,100	2,585.00	26,108,500	
丸運	4,200	245.00	1,029,000	
丸全昭和運輸	8,300	3,830.00	31,789,000	
センコーグループホールディングス	70,500	1,054.00	74,307,000	
トナミホールディングス	2,900	4,450.00	12,905,000	
ニッコンホールディングス	42,600	3,243.00	138,151,800	
日本石油輸送	900	2,722.00	2,449,800	
福山通運	10,100	3,920.00	39,592,000	
セイノーホールディングス	74,900	2,167.50	162,345,750	
エスライングループ本社	2,400	879.00	2,109,600	

神奈川中央交通	3,800	3,115.00	11,837,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	32,200	2,077.00	66,879,400	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	12,700	1,308.00	16,611,600	
日本郵船	356,500	3,957.00	1,410,670,500	
商船三井	235,000	4,136.00	971,960,000	
川崎汽船	100,200	5,468.00	547,893,600	
ＮＳユナイテッド海運	7,200	4,155.00	29,916,000	
明海グループ	8,700	768.00	6,681,600	
飯野海運	48,900	1,067.00	52,176,300	
共栄タンカー	1,700	855.00	1,453,500	
九州旅客鉄道	94,200	3,094.00	291,454,800	
ＳＧホールディングス	255,800	1,932.50	494,333,500	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	45,200	7,873.00	355,859,600	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	8,300	3,465.00	28,759,500	
日本航空	327,300	2,826.50	925,113,450	
ＡＮＡホールディングス	362,600	3,047.00	1,104,842,200	
ビーウィズ	3,400	2,278.00	7,745,200	
パスコ	1,800	1,625.00	2,925,000	
ＴＲＥホールディングス	28,900	1,185.00	34,246,500	
人・夢・技術グループ	5,200	1,584.00	8,236,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,600	4,910.00	17,676,000	
シルバーライフ	2,700	1,040.00	2,808,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	1,999.00	1,399,300	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,200	5,490.00	34,038,000	
コーア商事ホールディングス	7,900	724.00	5,719,600	
ＫＰＰグループホールディングス	32,900	674.00	22,174,600	
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	1,200.00	1,920,000	
ブックオフグループホールディングス	6,200	1,201.00	7,446,200	
ギフトホールディングス	6,100	2,071.00	12,633,100	
三菱倉庫	28,600	3,980.00	113,828,000	
三井倉庫ホールディングス	12,400	4,155.00	51,522,000	
住友倉庫	35,900	2,426.00	87,093,400	
澁澤倉庫	5,300	2,993.00	15,862,900	
ヤマタネ	6,300	2,061.00	12,984,300	
東陽倉庫	2,340	1,442.00	3,374,280	
乾汽船	16,900	1,235.00	20,871,500	
日本トランスシティ	26,800	673.00	18,036,400	
ケイヒン	1,700	1,915.00	3,255,500	
中央倉庫	6,500	1,070.00	6,955,000	
川西倉庫	1,600	1,046.00	1,673,600	
安田倉庫	9,100	1,046.00	9,518,600	
ファイズホールディングス	1,700	1,085.00	1,844,500	
ＮＩＳＳＯホールディングス	10,500	768.00	8,064,000	
大栄環境	34,900	2,204.00	76,919,600	
日本管財ホールディングス	14,400	2,518.00	36,259,200	
東洋埠頭	2,600	1,451.00	3,772,600	
上組	63,900	3,143.00	200,837,700	
サンリツ	2,000	728.00	1,456,000	

キムラユニティー	4,300	1,254.00	5,392,200	
キユーソー流通システム	4,600	960.00	4,416,000	
東海運	5,200	289.00	1,502,800	
エーアイテイー	8,400	1,658.00	13,927,200	
内外トランスライン	5,300	2,425.00	12,852,500	
ショーエイコーポレーション	2,400	600.00	1,440,000	
日本コンセプト	4,900	1,734.00	8,496,600	
ＴＢＳホールディングス	68,500	2,425.50	166,146,750	
日本テレビホールディングス	118,500	1,503.50	178,164,750	
朝日放送グループホールディングス	12,400	670.00	8,308,000	
テレビ朝日ホールディングス	32,500	1,658.00	53,885,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	118,800	715.00	84,942,000	
テレビ東京ホールディングス	9,600	2,946.00	28,281,600	
日本ＢＳ放送	3,200	914.00	2,924,800	
ビジョン	20,200	1,391.00	28,098,200	
スマートバリュー	2,100	382.00	802,200	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	15,000	3,230.00	48,450,000	
ワイヤレスゲート	3,800	201.00	763,800	
日本通信	123,500	218.00	26,923,000	
クロップス	1,500	945.00	1,417,500	
日本電信電話	42,886,300	175.90	7,543,700,170	
ＫＤＤＩ	1,034,500	4,552.00	4,709,044,000	
ソフトバンク	2,151,800	1,678.00	3,610,720,400	
光通信	15,800	22,215.00	350,997,000	
エムティーアイ	9,200	591.00	5,437,200	
ＧＭＯインターネットグループ	49,400	2,290.50	113,150,700	
ファイバーゲート	7,200	1,223.00	8,805,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,100	250.00	525,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	70,700	3,133.00	221,503,100	
学研ホールディングス	22,300	848.00	18,910,400	
ゼンリン	22,900	919.00	21,045,100	
昭文社ホールディングス	3,900	323.00	1,259,700	
インプレスホールディングス	7,800	178.00	1,388,400	
東京電力ホールディングス	1,203,300	637.40	766,983,420	
中部電力	491,900	1,850.00	910,015,000	
関西電力	515,400	2,013.50	1,037,757,900	
中国電力	212,600	932.10	198,164,460	
北陸電力	125,900	780.00	98,202,000	
東北電力	326,300	962.80	314,161,640	
四国電力	114,000	1,033.00	117,762,000	
九州電力	307,700	965.80	297,176,660	
北海道電力	129,000	635.50	81,979,500	
沖縄電力	31,200	1,107.00	34,538,400	
電源開発	100,600	2,392.00	240,635,200	
エフオン	8,700	486.00	4,228,200	
イーレックス	23,700	778.00	18,438,600	
レノバ	35,600	1,087.00	38,697,200	
東京瓦斯	282,200	3,595.00	1,014,509,000	

大阪瓦斯	270,400	2,442.50	660,452,000	
東邦瓦斯	52,600	2,638.00	138,758,800	
北海道瓦斯	8,000	2,349.00	18,792,000	
広島ガス	28,200	389.00	10,969,800	
西部ガスホールディングス	12,400	1,952.00	24,204,800	
静岡ガス	26,500	1,011.00	26,791,500	
メタウォーター	16,000	1,893.00	30,288,000	
M&A総研ホールディングス	6,700	3,275.00	21,942,500	
アイネット	8,100	1,729.00	14,004,900	
松竹	7,600	9,740.00	74,024,000	
東宝	83,800	5,078.00	425,536,400	
エイチ・アイ・エス	39,900	1,729.00	68,987,100	
東映	3,700	18,820.00	69,634,000	
ラックランド	6,200	2,920.00	18,104,000	
ＮＴＴデータグループ	420,000	1,922.00	807,240,000	
共立メンテナンス	23,500	5,966.00	140,201,000	
イチネンホールディングス	14,500	1,404.00	20,358,000	
建設技術研究所	7,100	4,660.00	33,086,000	
スペース	9,000	922.00	8,298,000	
アインホールディングス	19,400	4,285.00	83,129,000	
燦ホールディングス	11,900	1,063.00	12,649,700	
ピー・シー・エー	7,700	1,167.00	8,985,900	
スバル興業	600	12,130.00	7,278,000	
東京テアトル	3,300	1,103.00	3,639,900	
タナベコンサルティンググループ	3,600	1,152.00	4,147,200	
ビジネスブレイン太田昭和	5,600	2,141.00	11,989,600	
ナガワ	3,700	6,940.00	25,678,000	
東京都競馬	11,500	3,965.00	45,597,500	
常磐興産	3,100	1,254.00	3,887,400	
カナモト	21,300	2,545.00	54,208,500	
ＤＴＳ	28,500	3,340.00	95,190,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,300	5,123.00	344,777,900	
シーイーシー	18,800	1,673.00	31,452,400	
カプコン	133,000	5,451.00	724,983,000	
ニシオホールディングス	12,700	3,385.00	42,989,500	
アイ・エス・ビー	6,800	1,375.00	9,350,000	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	59,100	24.00	1,418,400	
日本空港ビルデング	46,500	6,356.00	295,554,000	
トランス・コスモス	17,000	3,165.00	53,805,000	
乃村工藝社	59,900	915.00	54,808,500	
ジャステック	8,300	1,556.00	12,914,800	
ＳＣＳＫ	109,300	2,543.50	278,004,550	
藤田観光	5,400	4,190.00	22,626,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,300	1,227.00	10,184,100	
トーカイ	12,200	1,919.00	23,411,800	
白洋舎	1,500	2,541.00	3,811,500	
セコム	139,700	10,430.00	1,457,071,000	
ＮＳＷ	5,200	2,800.00	14,560,000	

セントラル警備保障	7,400	3,050.00	22,570,000	
アイネス	9,400	1,607.00	15,105,800	
丹青社	26,600	913.00	24,285,800	
メイテックグループホールディングス	53,600	2,674.50	143,353,200	
ＴＫＣ	21,300	3,585.00	76,360,500	
富士ソフト	26,900	5,440.00	146,336,000	
応用地質	12,700	2,361.00	29,984,700	
船井総研ホールディングス	28,500	2,642.00	75,297,000	
ＮＳＤ	47,800	2,930.00	140,054,000	
進学会ホールディングス	3,000	288.00	864,000	
丸紅建材リース	800	2,649.00	2,119,200	
オオバ	5,600	914.00	5,118,400	
コナミグループ	57,400	8,029.00	460,864,600	
いであ	2,400	1,659.00	3,981,600	
学究社	5,400	2,004.00	10,821,600	
ベネッセホールディングス	51,300	1,821.50	93,442,950	
イオンディライト	15,300	3,370.00	51,561,000	
ナック	5,900	963.00	5,681,700	
福井コンピュータホールディングス	9,300	2,657.00	24,710,100	
ダイセキ	28,000	4,315.00	120,820,000	
ステップ	5,000	1,720.00	8,600,000	
泉州電業	7,100	3,370.00	23,927,000	
元気寿司	4,000	5,080.00	20,320,000	
トラスコ中山	29,700	2,402.00	71,339,400	
ヤマダホールディングス	578,900	461.10	266,930,790	
オートバックスセブン	49,100	1,553.00	76,252,300	
モリト	10,000	1,338.00	13,380,000	
アークランズ	42,200	1,538.00	64,903,600	
ニトリホールディングス	57,200	15,975.00	913,770,000	
グルメ杵屋	11,500	1,083.00	12,454,500	
愛眼	7,100	174.00	1,235,400	
ケーユーホールディングス	8,400	1,161.00	9,752,400	
吉野家ホールディングス	55,300	3,054.00	168,886,200	
加藤産業	17,400	3,915.00	68,121,000	
北恵	2,400	1,000.00	2,400,000	
イノテック	8,900	1,635.00	14,551,500	
イエローハット	24,900	1,832.00	45,616,800	
松屋フーズホールディングス	6,700	4,160.00	27,872,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,700	3,020.00	29,294,000	
ＪＫホールディングス	10,900	961.00	10,474,900	
サガミホールディングス	22,700	1,324.00	30,054,800	
日伝	8,400	2,625.00	22,050,000	
関西フードマーケット	12,700	1,382.00	17,551,400	
ミロク情報サービス	12,200	1,574.00	19,202,800	
北沢産業	5,000	276.00	1,380,000	
杉本商事	6,300	2,203.00	13,878,900	
因幡電機産業	36,700	3,330.00	122,211,000	
王将フードサービス	9,300	6,950.00	64,635,000	
ミニストップ	10,200	1,478.00	15,075,600	
アークス	25,900	2,725.00	70,577,500	

バローホールディングス	26,900	2,256.00	60,686,400	
東テク	4,700	5,210.00	24,487,000	
ミスミグループ本社	213,300	2,423.00	516,825,900	
アルテック	5,000	260.00	1,300,000	
ベルク	7,000	6,850.00	47,950,000	
大　庄	5,100	1,105.00	5,635,500	
タキヒヨー	2,300	1,000.00	2,300,000	
ファーストリテイリング	63,500	33,750.00	2,143,125,000	
ソフトバンクグループ	660,300	6,527.00	4,309,778,100	
蔵王産業	1,600	2,453.00	3,924,800	
スズケン	41,400	4,601.00	190,481,400	
サンドラッグ	53,600	4,134.00	221,582,400	
サックスバー　ホールディングス	13,400	892.00	11,952,800	
ジェコス	8,500	950.00	8,075,000	
ヤマザワ	1,800	1,268.00	2,282,400	
やまや	2,000	2,913.00	5,826,000	
グローセル	11,300	468.00	5,288,400	
ベルーナ	33,900	665.00	22,543,500	
合計	205,070,992		444,182,914,222	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,668,006,386
国債証券	469,917,450,050
地方債証券	30,438,712,464
特殊債券	28,856,474,396
社債券	24,562,396,970
未収利息	570,092,679
前払費用	42,354,178
流動資産合計	556,055,487,123
資産合計	556,055,487,123
負債の部	
流動負債	
未払解約金	107,975,000
流動負債合計	107,975,000
負債合計	107,975,000
純資産の部	
元本等	
元本	450,880,361,068
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	105,067,151,055
元本等合計	555,947,512,123
純資産合計	555,947,512,123
負債純資産合計	556,055,487,123

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月12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	618,708,264,968円
同期中追加設定元本額	760,339,415,366円
同期中一部解約元本額	928,167,319,266円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,812,500,303円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	56,117,188円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	91,187,184円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	49,144,456円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	793,387,160円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	269,269,922円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	40,190,856円
たわらノーロード　国内債券	18,960,508,726円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	5,033,325,596円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,460,247,667円
たわらノーロード　バランス（標準型）	2,742,786,253円
たわらノーロード　バランス（積極型）	368,709,671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）	166,717,288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）	2,196,965,389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）	2,332,674,898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）	656,188,780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）	29,926,724円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	22,103,142円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	186,381,615円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,472,032円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	62,284円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	13,797,924,247円
Ｏｎｅグローバルバランス	69,650,932円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	10,518,697,920円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	15,254,171,668円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	6,811,285,189円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,582,029,369円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,627,233,241円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	495,674,470円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	75,341,858円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,843,395,929円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	13,036,864円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	5,095,776,499円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,246,322,447円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	455,345,604円
投資のソムリエ	107,832,473,991円
クルーズコントロール	913,271,528円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	9,485,236,289円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	6,090,855,981円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,854,791,983円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	9,726,762,320円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	34,971,856,696円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	425,062,685円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	217,904,104円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	76,610,895円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,870,865,453円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,216,144,056円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	9,727,905,936円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,889,145,527円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	452,288,397円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	232,393,263円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	141,358,400円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,878,524,095円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	33,408,587円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	141,363,954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）	1,163,733,818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）	1,191,482,768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）	1,543,712,464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）	727,333,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	1,149,273,365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）	2,972,877,328円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	1,960,125,052円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	1,037,529,428円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	2,008,043,556円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	10,274,780,237円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,294,012,068円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	3,120,775,540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）	579,745,060円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	261,656,465円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	4,665,654,869円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	4,676,992,168円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	4,633,549,045円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,946,609,532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）	48,924,484円
ＡＭＯｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	911,099,189円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	151,282,805円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	90,356,788円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,863,742円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,846,181円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,509,639円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	363,477円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,889,297円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	93,985,153円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,781,925,425円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,129,420,905円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,273,322,016円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	54,622,933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）	136,767,038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）	1,617,649,378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）	89,473,886円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	553,892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）	1,649,385,858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）	35,450,477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）	265,711,401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）	415,404,717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）	777,645,049円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	203,596,921円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	96,281,977円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	748,262,131円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	252,012,428円
コア資産形成ファンド	150,520,192円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ専用＞	18,334,458,613円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	29,922,119,739円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	18,545,717,415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］	439,830,631円
計	450,880,361,068円
２．　受益権の総数	450,880,361,068口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年10月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△9,069,698,450
地方債証券	△104,488,700
特殊債券	△204,787,255
社債券	△34,074,310
合計	△9,413,048,715

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月15日から2023年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.2330円

（1万口当たり純資産額）	(12,330円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2023年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	４４２回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,000,780,000	
	４４３回　利付国庫債券（２年）	2,200,000,000	2,201,606,000	
	４４４回　利付国庫債券（２年）	2,700,000,000	2,701,809,000	
	４４５回　利付国庫債券（２年）	2,400,000,000	2,401,392,000	
	４４６回　利付国庫債券（２年）	1,900,000,000	1,900,912,000	
	４４７回　利付国庫債券（２年）	2,600,000,000	2,600,754,000	
	４４８回　利付国庫債券（２年）	2,000,000,000	2,000,300,000	
	４４９回　利付国庫債券（２年）	3,900,000,000	3,900,000,000	
	４５０回　利付国庫債券（２年）	2,200,000,000	2,199,802,000	
	４５２回　利付国庫債券（２年）	500,000,000	499,810,000	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	2,930,000,000	2,935,361,900	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,700,000,000	3,706,882,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	4,530,000,000	4,537,972,800	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	7,250,000,000	7,263,267,500	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	5,200,000,000	5,207,904,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	3,250,000,000	3,246,035,000	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	4,210,000,000	4,202,085,200	
	１４９回　利付国庫債券（５年）	3,380,000,000	3,371,076,800	
	１５０回　利付国庫債券（５年）	4,470,000,000	4,454,355,000	
	１５１回　利付国庫債券（５年）	3,800,000,000	3,783,090,000	

１５２回　利付国庫債券（５年）	2,990,000,000	2,986,412,000	
１５３回　利付国庫債券（５年）	4,110,000,000	4,086,655,200	
１５４回　利付国庫債券（５年）	5,200,000,000	5,181,696,000	
１５５回　利付国庫債券（５年）	1,800,000,000	1,805,958,000	
１５６回　利付国庫債券（５年）	3,600,000,000	3,597,012,000	
１５７回　利付国庫債券（５年）	1,900,000,000	1,895,820,000	
１５８回　利付国庫債券（５年）	3,600,000,000	3,576,312,000	
１５９回　利付国庫債券（５年）	2,100,000,000	2,082,507,000	
１６０回　利付国庫債券（５年）	900,000,000	896,670,000	
１６１回　利付国庫債券（５年）	1,000,000,000	1,000,920,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	127,928,900	
２回　利付国庫債券（４０年）	330,000,000	369,801,300	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	604,114,200	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	805,428,000	
５回　利付国庫債券（４０年）	710,000,000	764,002,600	
６回　利付国庫債券（４０年）	940,000,000	989,491,000	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,280,000,000	1,286,438,400	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,390,000,000	1,292,644,400	
９回　利付国庫債券（４０年）	2,090,000,000	1,416,811,000	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,830,000,000	1,457,320,500	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,540,000,000	1,177,576,400	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,520,000,000	1,031,152,800	
１３回　利付国庫債券（４０年）	1,990,000,000	1,334,155,700	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,000,000,000	1,431,160,000	
１５回　利付国庫債券（４０年）	2,340,000,000	1,841,509,800	
１６回　利付国庫債券（４０年）	800,000,000	688,688,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,006,580,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	2,300,000,000	2,309,683,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	3,230,000,000	3,249,896,800	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	3,980,000,000	4,007,143,600	

３４０回　利付国庫債券（１０年）	6,540,000,000	6,590,031,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	3,620,000,000	3,641,321,800	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	3,520,000,000	3,523,836,800	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,090,000,000	4,092,699,400	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	3,570,000,000	3,570,499,800	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	5,190,000,000	5,187,508,800	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	4,840,000,000	4,834,192,000	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	5,390,000,000	5,378,142,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,070,000,000	4,055,673,600	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	5,050,000,000	5,024,851,000	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	6,060,000,000	6,020,125,200	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	4,990,000,000	4,948,433,300	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	4,650,000,000	4,603,593,000	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	4,990,000,000	4,935,209,800	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	4,260,000,000	4,207,687,200	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	5,430,000,000	5,355,771,900	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	4,200,000,000	4,134,102,000	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	4,220,000,000	4,144,799,600	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	4,650,000,000	4,555,326,000	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	4,550,000,000	4,446,624,000	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	4,600,000,000	4,484,126,000	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	5,200,000,000	5,053,932,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	5,410,000,000	5,239,855,500	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	5,770,000,000	5,570,300,300	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	5,550,000,000	5,339,710,500	

３６５回　利付国庫債券（１０年）	5,630,000,000	5,399,789,300	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	6,080,000,000	5,863,552,000	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	5,400,000,000	5,191,668,000	
３６８回　利付国庫債券（１０年）	5,450,000,000	5,225,187,500	
３６９回　利付国庫債券（１０年）	5,320,000,000	5,228,123,600	
３７０回　利付国庫債券（１０年）	5,100,000,000	5,000,856,000	
３７１回　利付国庫債券（１０年）	5,100,000,000	4,943,277,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	125,710,200	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	112,466,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	233,730,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	228,704,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	272,675,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	259,674,600	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	168,061,500	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	395,042,600	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	305,008,600	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	281,882,400	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	314,676,900	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	462,120,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	323,842,400	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	389,218,500	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	358,645,200	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	342,455,200	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	413,756,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	382,202,700	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	726,224,600	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	734,204,000	

２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	911,649,200	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,005,357,200	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,015,968,800	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	819,612,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,117,216,900	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,302,790,800	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,359,276,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,166,222,600	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,505,876,600	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,469,480,000	
３８回　利付国庫債券（３０年）	850,000,000	901,246,500	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,210,000,000	1,301,355,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	1,088,277,400	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,100,513,200	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,349,101,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,310,000,000	1,357,788,800	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	1,169,730,800	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,350,000,000	1,347,826,500	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	1,764,265,200	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,640,000,000	1,662,746,800	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,580,212,800	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,700,000,000	1,656,531,000	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,550,000,000	1,332,101,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,234,537,200	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,700,000,000	1,355,512,000	

５３回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	992,677,400	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,690,000,000	1,437,514,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,080,000,000	915,861,600	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,140,000,000	963,790,200	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,530,000,000	1,289,560,500	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,142,780,800	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	915,689,600	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	881,062,000	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	1,022,464,800	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	859,230,400	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	817,300,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,110,030,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,031,884,000	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,090,000,000	800,190,800	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,670,000,000	1,292,429,700	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,640,000,000	1,264,620,400	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,660,000,000	1,312,313,000	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,540,000,000	1,214,397,800	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,480,000,000	1,164,123,600	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,590,000,000	1,247,482,200	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,590,000,000	1,245,478,800	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,590,000,000	1,350,768,600	
７５回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,392,016,000	
７６回　利付国庫債券（３０年）	1,620,000,000	1,519,835,400	
７７回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,475,055,000	

７８回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,311,170,000	
７９回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	889,940,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	389,268,200	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,023,200	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	185,495,400	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	71,936,200	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,163,600	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	258,025,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,689,000	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	93,192,300	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	415,452,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	145,679,800	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	73,165,400	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	177,316,800	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	619,311,200	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	126,544,800	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	126,253,200	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	625,169,900	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,569,400	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	499,046,000	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	117,120,300	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,233,288,800	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	393,643,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	715,104,400	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	593,224,500	

９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	128,551,200	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	711,975,000	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	171,974,400	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	808,650,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	901,346,800	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	251,790,200	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	549,270,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	175,025,600	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	119,312,600	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	696,377,600	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	546,480,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	655,152,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	746,373,000	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	379,631,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	481,949,600	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	508,001,000	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	813,089,800	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,509,438,600	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	410,000,000	452,758,900	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	399,722,400	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	589,826,400	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	520,106,700	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	611,815,350	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	511,839,400	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	702,425,600	

１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	621,761,700	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	389,522,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	673,098,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	564,621,000	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	593,962,200	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	407,429,200	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	996,122,400	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,600,400	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	689,793,300	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	219,088,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	141,364,600	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	388,425,600	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	522,288,000	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,135,461,400	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,057,831,600	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	2,250,000,000	2,449,530,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,154,976,000	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	472,251,800	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,230,000,000	1,329,125,700	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	803,797,500	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,250,000,000	2,454,075,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,443,571,200	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	2,490,000,000	2,692,835,400	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	2,530,000,000	2,710,970,900	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,590,000,000	2,773,915,900	

１５０回　利付国庫債券（２０年）	3,130,000,000	3,317,174,000	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	3,160,000,000	3,277,994,400	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,640,000,000	2,734,855,200	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,340,000,000	2,446,704,000	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	2,720,000,000	2,807,937,600	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,480,000,000	2,498,996,800	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,132,256,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,680,000,000	2,433,172,000	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,640,000,000	2,481,679,200	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	2,340,000,000	2,220,589,800	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	2,220,000,000	2,127,270,600	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	2,260,000,000	2,129,372,000	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	2,230,000,000	2,092,721,200	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,430,000,000	2,271,126,600	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,450,000,000	2,248,683,500	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	2,050,000,000	1,873,167,000	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	2,140,000,000	2,004,452,400	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	1,450,000,000	1,312,859,000	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	1,790,000,000	1,588,016,400	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	1,920,000,000	1,667,673,600	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,641,562,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,840,000,000	1,582,308,000	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,580,000,000	1,375,342,600	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,560,000,000	2,216,729,600	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	2,500,000,000	2,154,775,000	

	１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,420,000,000	2,112,418,000	
	１７６回　利付国庫債券（２０年）	2,400,000,000	2,085,624,000	
	１７７回　利付国庫債券（２０年）	2,750,000,000	2,336,977,500	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	2,600,000,000	2,242,006,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	2,500,000,000	2,147,375,000	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	2,620,000,000	2,368,846,800	
	１８１回　利付国庫債券（２０年）	2,210,000,000	2,028,315,900	
	１８２回　利付国庫債券（２０年）	2,220,000,000	2,104,537,800	
	１８３回　利付国庫債券（２０年）	2,060,000,000	2,050,688,800	
	１８４回　利付国庫債券（２０年）	1,980,000,000	1,865,021,400	
	１８５回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,501,584,000	
国債証券　合計		482,995,000,000	469,917,450,050	
地方債証券	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,504,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	109,059,500	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	194,642,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	389,308,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	290,496,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	224,820,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	107,902,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	102,905,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	103,951,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	212,018,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	318,498,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	109,406,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,042,000	
	３１回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	205,500,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,570,000	
	３０年度８回　北海道公募公債	400,000,000	396,440,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	394,708,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	96,277,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	241,735,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	100,649,000	

２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	196,858,000	
２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	193,328,000	
２５８回　神奈川県公募公債　１０年	300,000,000	287,589,000	
３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	117,756,000	
１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	109,006,000	
１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	330,582,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	108,501,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,353,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,703,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	191,750,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	192,392,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	191,428,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	190,236,000	
４７４回　大阪府公募公債　１０年	300,000,000	285,180,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	215,260,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	101,519,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	92,802,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	297,627,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	351,743,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	108,519,864	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	389,116,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	193,560,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	201,030,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	194,452,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	96,278,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	113,583,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	208,026,000	

５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	312,297,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	102,931,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	101,447,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	194,758,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	96,837,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	192,426,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,105,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,293,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	203,156,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	103,980,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	327,747,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	330,399,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	109,573,000	
２６年度４回　愛知県公募公債　２０年	200,000,000	212,100,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	148,093,500	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	100,690,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	196,320,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	214,491,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	99,195,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	193,544,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	82,165,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	85,724,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	195,004,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	172,244,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	219,234,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	110,153,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	106,735,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	318,237,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	101,640,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	99,959,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	197,516,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	194,996,000	

令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	96,700,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,028,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	145,584,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	108,192,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	110,457,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	321,111,000	
２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	201,738,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	99,804,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	190,538,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	102,519,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	101,267,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	91,424,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	193,000,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	105,863,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,795,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,228,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	604,314,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,905,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,277,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,699,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,697,600	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,328,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,925,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,885,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,850,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,700,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,356,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,460,000	

１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,285,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,806,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	294,000,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	487,900,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,167,000	
２２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	479,110,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	476,955,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	98,684,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	193,182,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	100,519,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,345,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	198,754,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	291,483,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	218,008,000	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	193,896,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	105,818,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	101,849,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	106,691,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	221,066,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	215,378,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	297,591,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	153,330,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	389,164,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	115,867,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	108,294,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	105,878,000	
２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	109,510,000	
２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	276,468,000	
第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	197,728,000	
６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	219,142,000	
５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	109,418,000	

	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	108,036,000	
	１１回　北九州市公募公債　２０年	300,000,000	329,466,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	105,765,000	
	２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	112,670,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	183,602,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	84,832,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	100,485,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	185,050,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	298,242,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	92,207,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	297,573,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	194,902,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	193,182,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	100,482,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	196,690,000	
地方債証券　合計		30,589,330,000	30,438,712,464	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	206,922,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	205,298,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	299,058,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	424,395,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,758,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	77,067,000	
	１５６回　日本政策投資銀行債券	400,000,000	381,908,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,094,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	367,191,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	177,529,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	235,176,000	
	３６回　高速道路機構債	300,000,000	360,216,000	
	５０回　高速道路機構債	300,000,000	262,416,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,930,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,445,000	
	１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,125,000	
	１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	98,549,000	

１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,936,000	
１６９回　高速道路機構債	100,000,000	90,952,000	
１７２回　高速道路機構債	200,000,000	179,430,000	
２１０回　高速道路機構債	100,000,000	91,474,000	
９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,667,000	
１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,698,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	541,085,000	
１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,482,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,079,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	305,370,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	502,815,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,860,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,644,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	191,618,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	503,190,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	93,591,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,076,000	
２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	180,956,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,662,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	797,168,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	186,294,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	91,900,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	218,022,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	138,888,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	150,758,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	152,722,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	588,380,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	216,148,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	329,292,000	

２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	329,760,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	110,080,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,385,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	216,410,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	106,982,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	214,262,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,830,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	324,414,000	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	105,700,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	520,205,000	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	297,864,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,483,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	204,322,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	300,990,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	398,836,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,621,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	93,439,000	
９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,025,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,628,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,319,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,063,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	250,146,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	220,689,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,295,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	216,680,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,702,330	

２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	104,159,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	103,209,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	203,620,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	154,578,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	105,692,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	100,556,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	218,524,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,592,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	383,775,000	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,915,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,919,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,299,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	263,705,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,260,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,684,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,686,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	297,939,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,056,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	90,688,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	496,505,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	496,505,000	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,016,000	41,292,858	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,930,000	15,514,658	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,795,000	99,326,201	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,728,000	148,608,393	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,065,000	20,810,615	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,196,000	17,831,908	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,196,000	20,847,926	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,175,000	21,846,882	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,956,000	26,668,492	

６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,862,000	65,033,867	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,874,000	29,505,763	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,073,000	35,416,715	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,734,000	36,082,763	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,477,000	39,766,761	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,866,000	40,877,851	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,204,000	45,353,384	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,116,000	51,529,173	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,990,000	53,690,355	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	204,090,000	195,785,577	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,233,000	66,759,997	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,914,000	66,544,047	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,129,000	66,680,450	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	216,243,000	207,275,402	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	216,003,000	206,922,233	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,094,000	140,760,132	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	220,716,000	210,801,437	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	218,952,000	209,186,740	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	380,795,000	364,835,880	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,883,000	72,626,860	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,539,000	74,291,610	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	252,951,000	237,528,577	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	336,648,000	317,041,620	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,587,000	244,585,467	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	265,191,000	249,921,302	

	１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	809,496,000	760,877,670	
	６回　沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	412,716,000	
	２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,782,000	
	い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,782,000	
	い第８５１号　利付商工債	300,000,000	298,260,000	
	い第８５４号　利付商工債	300,000,000	297,843,000	
	い第８５５号　利付商工債	200,000,000	198,462,000	
	３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	399,052,000	
	３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	298,485,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	107,159,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,292,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	296,232,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	299,181,000	
	８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	398,212,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	100,493,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,075,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	191,788,000	
特殊債券　合計		29,036,717,000	28,856,474,396	
社債券	２５回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１７）	300,000,000	293,889,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,424,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	98,729,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	398,604,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	84,479,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,586,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	194,970,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	298,278,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,852,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	198,782,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	496,435,000	
	２５回　西日本高速道路社債	200,000,000	200,970,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	100,701,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	299,670,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	200,082,000	
	６１回　西日本高速道路債券	500,000,000	497,000,000	
	６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	496,435,000	
	２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	198,572,000	
	１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	100,562,000	

３回　ダイドーグループＨＤ社債	300,000,000	290,844,000	
９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	93,400,000	
１２回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	100,000,000	100,870,000	
１４回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,390,000	
３０回　東レ社債	300,000,000	298,068,000	
４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	198,694,000	
２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	182,226,000	
４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,156,000	
１７回　ダイセル社債	300,000,000	289,170,000	
１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	473,240,000	
４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,841,000	
４回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	300,000,000	289,044,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	294,672,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	297,621,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	99,952,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	95,771,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	189,256,000	
５８回　川崎重工業社債	300,000,000	283,467,000	
５回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	98,824,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	198,818,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	90,864,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	389,860,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	398,604,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	106,454,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,675,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	297,378,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	200,736,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,951,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	296,997,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	387,640,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	297,705,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,151,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,353,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	192,782,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	286,374,000	

２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	97,843,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	198,686,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,642,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	192,432,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	297,399,000	
３回　野村ホールディングス社債	300,000,000	296,451,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	99,992,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	199,350,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	102,918,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	88,139,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,171,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	207,248,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	108,725,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,487,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	217,626,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	92,622,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	85,215,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	90,145,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,901,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	70,213,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,206,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	167,758,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	149,222,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,637,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	193,504,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	75,869,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	70,621,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,348,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	167,248,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,204,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	126,663,600	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	68,831,000	
７回　ニッコンＨＤ社債	300,000,000	289,623,000	
６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	192,788,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	388,644,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	185,118,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	89,644,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	193,418,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	101,126,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	299,007,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	390,652,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	168,122,000	

	５４１回　関西電力社債	300,000,000	282,180,000	
	３９６回　中国電力社債	200,000,000	189,988,000	
	４２５回　中国電力社債	100,000,000	96,166,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	101,804,000	
	３１１回　北陸電力社債	100,000,000	101,148,000	
	４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,536,000	
	５２１回　東北電力社債	400,000,000	386,676,000	
	５２５回　東北電力社債	200,000,000	197,122,000	
	５３６回　東北電力社債	300,000,000	280,506,000	
	３２０回　四国電力社債	300,000,000	283,563,000	
	４６３回　九州電力社債	100,000,000	87,743,000	
	４６６回　九州電力社債	100,000,000	86,608,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	283,266,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	80,879,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	198,394,000	
	５０７回　九州電力社債	200,000,000	190,140,000	
	３２１回　北海道電力社債	261,000,000	263,132,370	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	299,475,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	174,826,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	205,884,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	99,140,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	187,304,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	181,200,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	85,297,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	81,819,000	
	５７回　東京瓦斯社債	300,000,000	197,304,000	
	7回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	198,034,000	
	8回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	181,936,000	
社債券　合計		25,481,000,000	24,562,396,970	
合計			553,775,033,880	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	8,219,448,160
コール・ローン	1,520,869,620
株式	1,062,956,630,858
投資信託受益証券	1,635,442,490
投資証券	19,502,616,492
派生商品評価勘定	141,576,462
未収配当金	860,059,060
差入委託証拠金	8,097,660,976
流動資産合計	1,102,934,304,118
資産合計	1,102,934,304,118
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	200,274,858
未払解約金	25,958,000
流動負債合計	226,232,858
負債合計	226,232,858
純資産の部	
元本等	
元本	150,516,972,968
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	952,191,098,292
元本等合計	1,102,708,071,260
純資産合計	1,102,708,071,260
負債純資産合計	1,102,934,304,118

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12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。 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。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月12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	124,720,616,433円
同期中追加設定元本額	57,546,414,721円
同期中一部解約元本額	31,750,058,186円

元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,750,342,931円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,865,878円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	7,964,353円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	20,322,262円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,375,109円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	23,496,762円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	16,508,496円
たわらノーロード　先進国株式	52,705,801,413円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	300,919,387円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,850,562,877円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	890,697,093円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	83,810,670円
たわらノーロード　バランス（標準型）	759,835,975円
たわらノーロード　バランス（積極型）	994,025,781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）	34,495,247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）	225,244,057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）	235,178,829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）	404,033,833円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,447円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	293,769円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	14,371,442円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,718,583円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,712,292円
たわらノーロード　全世界株式	1,124,100,521円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	56,193,139,136円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	3,124,121,110円
Ｏｎｅグローバルバランス	17,655,147円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	144,071,172円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	786,104,094円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,029,593,459円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	85,216,821円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	241,011,603円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	243,878,266円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,590,614円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	120,079,720円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	163,664,280円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	187,179,176円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	311,129,369円
投資のソムリエ	5,947,090,919円
クルーズコントロール	77,645,969円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	523,090,509円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	186,158,390円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	276,563,089円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	539,738,436円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,940,555,774円
ワールドアセットバランス（基本コース）	121,856,881円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	217,559,181円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	57,580,667円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	29,425,550円

リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,252,171円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	167,669,251円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	139,001,924円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	968,850,817円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	136,286,413円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	59,620,684円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	31,483,183円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	19,114,510円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	130,182,296円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,533,391円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	34,964,356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）	653,645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）	752,790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）	496,066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）	708,336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）	1,530,912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）	597,645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）	335,381,172円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	35,412,248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）	1,107,506,924円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,745,796円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,268,307,761円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	172,053,673円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	363,221円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,826,884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）	1,234,941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）	2,740,183円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,549,114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）	38,631,716円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,528,053円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,229,024円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,008,055円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,131円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	899,092円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,064,292円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	118,779,928円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	212,248,411円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	730,347,553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）	31,190,803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）	28,082,780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）	184,084,451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）	5,115,534円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	142,173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）	70,436,332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）	6,058,954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）	22,711,287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）	35,490,373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）	79,725,309円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	13,317,338円
コア資産形成ファンド	8,038,970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＞	2,649,319,470円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	136,860,746円
たわらノーロード　先進国株式（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	11,570,986円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,592,593,643円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,934,975,245円
計	150,516,972,968円
２．　受益権の総数	150,516,972,968口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	37,998,677,678
投資信託受益証券	△57,527,483
投資証券	△2,850,406,049
合計	35,090,744,146

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月16日から2023年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,588,664,670	－	1,594,735,870	6,071,200
アメリカ・ドル	1,001,417,560	－	1,005,206,377	3,788,817
イギリス・ポンド	99,866,126	－	100,330,678	464,552
オーストラリア・ドル	50,431,127	－	50,467,225	36,098
カナダ・ドル	81,989,823	－	82,267,687	277,864
ユーロ	354,960,034	－	356,463,903	1,503,869
合計	1,588,664,670	－	1,594,735,870	6,071,200

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	18,854,139,656	－	18,789,370,060	△64,769,596
合計	18,854,139,656	－	18,789,370,060	△64,769,596

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	7.3261円 (73,261円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

2023年10月12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	1,289,446	131.830	169,987,666.180	
	ABBOTT LABORATORIES	243,281	92.640	22,537,551.840	
	AES CORP	90,680	13.390	1,214,205.200	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	127,099	143.230	18,204,389.770	
	ADVANCED MICRO DEVICES	223,468	108.310	24,203,819.080	
	ADOBE INC	63,562	549.910	34,953,379.420	
	CHUBB LTD	58,149	210.180	12,221,756.820	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	30,769	290.890	8,950,394.410	
	ALLSTATE CORP	35,641	114.770	4,090,517.570	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	93,039	187.400	17,435,508.600	

AMGEN INC	74,390	283.600	21,097,004.000	
HESS CORP	37,733	154.980	5,847,860.340	
AMERICAN EXPRESS CO	88,192	151.510	13,361,969.920	
AMERICAN ELECTRIC POWER	69,313	75.280	5,217,882.640	
AFLAC INC	83,202	79.800	6,639,519.600	
AMERICAN INTL GROUP	99,164	61.530	6,101,560.920	
ANALOG DEVICES	69,484	174.920	12,154,141.280	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	97,613	53.410	5,213,510.330	
VALERO ENERGY CORP	50,039	129.600	6,485,054.400	
ANSYS INC	11,587	304.880	3,532,644.560	
APPLE INC	2,197,121	179.800	395,042,355.800	
APPLIED MATERIALS INC	116,660	142.180	16,586,718.800	
ALBEMARLE CORP	16,885	164.800	2,782,648.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	78,760	73.700	5,804,612.000	
AMEREN CORP	38,938	77.390	3,013,411.820	
ARROW ELECTRONICS INC	7,023	119.010	835,807.230	
AUTODESK INC	29,385	213.200	6,264,882.000	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	57,549	249.460	14,356,173.540	
AUTOZONE INC	2,591	2,571.860	6,663,689.260	
AVERY DENNISON CORP	11,542	186.510	2,152,698.420	
BALL CORP	45,691	45.990	2,101,329.090	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	181,145	348.430	63,116,352.350	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	104,322	42.150	4,397,172.300	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	32.740	2,335,573.380	
BECTON DICKINSON & CO	39,422	261.300	10,300,968.600	
AMETEK INC	32,705	152.250	4,979,336.250	
VERIZON COMM INC	589,099	31.460	18,533,054.540	
WR BERKLEY CORP	30,631	64.140	1,964,672.340	
BEST BUY CO INC	29,593	70.950	2,099,623.350	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	357.000	1,078,497.000	
YUM! BRANDS INC	37,898	118.380	4,486,365.240	
FIRSTENERGY CORP	75,630	35.460	2,681,839.800	
BOEING CO	79,649	196.070	15,616,779.430	
ROBERT HALF INC	14,456	77.000	1,113,112.000	
BORGWARNER INC	29,975	39.970	1,198,100.750	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	206,139	50.910	10,494,536.490	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	85.990	1,481,865.670	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	24,629	144.750	3,565,047.750	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,933	1,107.080	3,247,065.640	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	293,293	56.650	16,615,048.450	

ONEOK INC	82,913	67.460	5,593,310.980	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	110.650	1,074,300.850	
UNITED RENTALS INC	9,916	454.070	4,502,558.120	
SEMPRA	88,786	69.270	6,150,206.220	
FEDEX CORP	32,918	255.460	8,409,232.280	
VERISIGN INC	13,302	210.090	2,794,617.180	
AMPHENOL CORP	84,731	84.640	7,171,631.840	
BROWN-FORMAN CORP	43,429	56.190	2,440,275.510	
QUANTA SERVICES INC	20,975	179.320	3,761,237.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.590	467,101.350	
CSX CORP	293,894	31.610	9,289,989.340	
COTERRA ENERGY INC	112,611	28.250	3,181,260.750	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	39.430	1,063,742.540	
CONSTELLATION BRANDS INC	23,956	239.000	5,725,484.000	
CARDINAL HEALTH INC	33,461	91.680	3,067,704.480	
CARLISLE COS INC	7,522	267.570	2,012,661.540	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	12.650	1,877,361.200	
CATERPILLAR INC	71,704	272.830	19,563,002.320	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	134.370	1,697,227.470	
JPMORGAN CHASE & CO	408,203	146.150	59,658,868.450	
CHURCH & DWIGHT CO INC	34,837	87.650	3,053,463.050	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,671	102.270	2,318,563.170	
CINTAS CORP	12,807	512.510	6,563,715.570	
CISCO SYSTEMS INC	569,349	53.660	30,551,267.340	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	15.740	1,091,899.540	
CLOROX COMPANY	18,305	122.360	2,239,799.800	
COCA-COLA CO/THE	576,198	53.710	30,947,594.580	
COPART INC	114,384	46.150	5,278,821.600	
COGNEX CORP	25,772	40.930	1,054,847.960	
COLGATE-PALMOLIVE CO	112,540	68.870	7,750,629.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	36,790	198.270	7,294,353.300	
MOLINA HEALTHCARE INC	7,616	340.480	2,593,095.680	
NRG ENERGY, INC.	34,874	41.270	1,439,249.980	
COMCAST CORP-CL A	581,376	44.240	25,720,074.240	
CONAGRA BRANDS INC	71,055	27.360	1,944,064.800	
CONSOLIDATED EDISON INC	46,058	88.450	4,073,830.100	
CMS ENERGY CORP	43,873	54.180	2,377,039.140	
COOPER COS INC	7,281	310.750	2,262,570.750	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	60.050	1,518,124.050	
CORNING INC	115,879	29.100	3,372,078.900	
WOLFSPEED INC	15,684	33.700	528,550.800	
SEALED AIR CORP	17,610	30.970	545,381.700	
HEICO CORP-CL A	9,463	133.910	1,267,190.330	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	7,878	209.490	1,650,362.220	

CUMMINS INC	18,916	230.050	4,351,625.800	
DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	46.460	1,106,026.760	
DR HORTON INC	41,113	108.670	4,467,749.710	
DANAHER CORP	97,832	216.430	21,173,779.760	
MOODY'S CORP	22,734	325.520	7,400,371.680	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	68,959	68.340	4,712,658.060	
TARGET CORP	63,536	108.990	6,924,788.640	
DEERE & CO	38,736	389.360	15,082,248.960	
MORGAN STANLEY	174,759	78.900	13,788,485.100	
REPUBLIC SERVICES INC	32,288	146.470	4,729,223.360	
COSTAR GROUP INC	57,938	81.870	4,743,384.060	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	509.070	1,897,303.890	
THE WALT DISNEY CO	254,869	84.850	21,625,634.650	
DOLLAR TREE INC	28,091	107.030	3,006,579.730	
DOVER CORP	17,145	142.180	2,437,676.100	
OMNICOM GROUP	26,669	74.840	1,995,907.960	
DTE ENERGY CO	30,474	97.840	2,981,576.160	
DUKE ENERGY CORP	111,102	89.870	9,984,736.740	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,594	137.520	2,419,526.880	
EBAY INC	75,181	43.050	3,236,542.050	
BANK OF AMERICA CORP	1,000,292	27.020	27,027,889.840	
CITIGROUP INC	270,018	41.530	11,213,847.540	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	74.230	1,246,321.700	
EATON CORP PLC	55,045	215.870	11,882,564.150	
CADENCE DESIGN SYS INC	38,973	252.980	9,859,389.540	
ECOLAB INC	36,605	169.750	6,213,698.750	
REVVITY INC	17,972	108.980	1,958,588.560	
ELECTRONIC ARTS INC	37,893	129.690	4,914,343.170	
SALESFORCE INC	135,649	206.850	28,058,995.650	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	305.300	1,029,471.600	
EMERSON ELECTRIC CO	79,101	97.090	7,679,916.090	
ATMOS ENERGY CORP	21,185	111.790	2,368,271.150	
ENTERGY CORP	30,815	94.960	2,926,192.400	
EOG RESOURCES INC	81,575	127.370	10,390,207.750	
EQUIFAX INC	16,146	186.600	3,012,843.600	
EQT CORP	51,269	43.550	2,232,764.950	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	33,270	140.430	4,672,106.100	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,788	117.000	2,666,196.000	
EXXON MOBIL CORP	565,160	106.490	60,183,888.400	
FMC CORP	17,711	62.760	1,111,542.360	
NEXTERA ENERGY INC	283,123	53.540	15,158,405.420	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	456.870	2,472,580.440	
FAIR ISAAC CORP	3,381	904.680	3,058,723.080	
ASSURANT INC	8,276	146.800	1,214,916.800	
FASTENAL CO	76,599	56.010	4,290,309.990	
FIFTH THIRD BANCORP	85,111	24.990	2,126,923.890	

M&T BANK CORP	21,769	125.710	2,736,580.990	
FIRST HORIZON CORP	69,634	10.610	738,816.740	
FISERV INC	85,177	113.550	9,671,848.350	
FORD MOTOR CO	563,883	12.250	6,907,566.750	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	23.700	898,609.200	
FREEPORT-MCMORAN INC	194,676	37.150	7,232,213.400	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	1,390.130	2,206,136.310	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,751	234.900	6,988,509.900	
DENTSPLY SIRONA INC	33,798	31.800	1,074,776.400	
GENERAL DYNAMICS CORP	33,504	237.780	7,966,581.120	
GENERAL MILLS INC	83,996	62.730	5,269,069.080	
GENUINE PARTS CO	19,809	146.770	2,907,366.930	
GILEAD SCIENCES INC	173,124	76.960	13,323,623.040	
GARTNER INC	11,345	360.820	4,093,502.900	
MCKESSON CORP	19,309	456.660	8,817,647.940	
NVIDIA CORP	344,718	468.060	161,348,707.080	
GRACO INC	23,985	75.880	1,819,981.800	
GENERAL ELECTRIC CO	151,379	113.260	17,145,185.540	
WW GRAINGER INC	6,074	714.290	4,338,597.460	
HALLIBURTON CO	121,086	41.640	5,042,021.040	
MONSTER BEVERAGE CORP	113,115	49.600	5,610,504.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	46,325	313.020	14,500,651.500	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	25,632	176.820	4,532,250.240	
HASBRO INC	21,174	58.240	1,233,173.760	
HENRY SCHEIN INC	17,431	73.440	1,280,132.640	
HEICO CORP	6,878	168.630	1,159,837.140	
HERSHEY FOODS CORP	19,554	191.770	3,749,870.580	
HP INC	124,613	26.830	3,343,366.790	
F5 INC	8,981	157.330	1,412,980.730	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	83.870	1,520,143.750	
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	234.580	1,459,556.760	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	26.200	1,145,333.000	
HOLOGIC INC	34,146	69.410	2,370,073.860	
HOME DEPOT INC	140,483	298.050	41,870,958.150	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	88.580	2,331,337.020	
HORMEL FOODS CORP	35,980	36.230	1,303,555.400	
CENTERPOINT ENERGY INC	78,047	27.750	2,165,804.250	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,776	390.200	1,863,595.200	
HUBBELL INC	7,826	310.630	2,430,990.380	
HUMANA INC	17,271	493.420	8,521,856.820	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,314	193.760	2,385,960.640	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	178,023	10.160	1,808,713.680	
BIOGEN INC	20,763	266.520	5,533,754.760	
IDEX CORP	11,156	209.030	2,331,938.680	

ILLINOIS TOOL WORKS	42,126	236.610	9,967,432.860	
INTUIT INC	39,008	541.580	21,125,952.640	
IDEXX LABORATORIES INC	12,015	445.880	5,357,248.200	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	32,771	211.300	6,924,512.300	
INTEL CORP	580,650	36.880	21,414,372.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	35,897	65.550	2,353,048.350	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	35.430	1,564,340.790	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	29.140	1,575,395.820	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,059	147.180	1,333,303.620	
JABIL CIRCUIT INC	15,856	138.500	2,196,056.000	
INCYTE CORP	22,728	56.960	1,294,586.880	
JOHNSON & JOHNSON	336,651	156.180	52,578,153.180	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	44,033	70.940	3,123,701.020	
KLA CORPORATION	18,936	482.630	9,139,081.680	
DEVON ENERGY CORP	86,432	46.750	4,040,696.000	
KELLANOVA	33,492	49.530	1,658,858.760	
KEYCORP	143,240	10.560	1,512,614.400	
KIMBERLY-CLARK CORP	45,701	119.350	5,454,414.350	
BLACKROCK INC/NEW YORK	20,869	642.670	13,411,880.230	
KROGER CO	99,244	44.190	4,385,592.360	
LAM RESEARCH CORP	18,592	641.730	11,931,044.160	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	412.590	2,707,002.990	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,551	154.310	2,091,054.810	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	80.920	1,639,439.200	
AKAMAI TECHNOLOGIES	19,795	108.370	2,145,184.150	
LENNAR CORP	33,398	114.270	3,816,389.460	
ELI LILLY & CO	112,575	605.280	68,139,396.000	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	31.110	875,933.160	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	101,175	155.300	15,712,477.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	39,643	113.380	4,494,723.340	
LOCKHEED MARTIN CORP	31,975	436.650	13,961,883.750	
LOEWS CORP	29,698	64.290	1,909,284.420	
LOWE'S COS INC	81,720	203.290	16,612,858.800	
DOMINION ENERGY INC	113,579	42.960	4,879,353.840	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	38.010	1,535,642.010	
MCCORMICK & CO INC	35,510	62.020	2,202,330.200	
MCDONALD'S CORPORATION	102,326	250.920	25,675,639.920	
S&P GLOBAL INC	45,479	371.900	16,913,640.100	
EVEREST GROUP LTD	5,528	392.500	2,169,740.000	
MARKEL GROUP INC	1,657	1,487.330	2,464,505.810	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	81,961	71.140	5,830,705.540	
MARSH & MCLENNAN COS	69,913	192.900	13,486,217.700	
MASCO CORP	33,476	53.630	1,795,317.880	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	8,118	436.690	3,545,049.420	
METLIFE INC	89,802	62.850	5,644,055.700	
MEDTRONIC PLC	185,884	72.890	13,549,084.760	
ACTIVISION BLIZZARD INC	109,648	94.470	10,358,446.560	
CVS HEALTH CORP	178,108	71.730	12,775,686.840	
MERCK & CO.INC.	354,291	103.460	36,654,946.860	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	62,344	95.140	5,931,408.160	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	13,267	199.890	2,651,940.630	
MICROSOFT CORP	986,731	332.420	328,009,119.020	
MICRON TECH INC	151,730	70.210	10,652,963.300	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	77,820	81.230	6,321,318.600	
3M CO	75,907	90.390	6,861,233.730	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	84.370	532,459.070	
ENTEGRIS INC	20,987	97.610	2,048,541.070	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	197.080	1,512,391.920	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,288	287.600	6,985,228.800	
ILLUMINA INC	21,056	137.920	2,904,043.520	
XCEL ENERGY INC	73,107	58.810	4,299,422.670	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,755	113.610	1,676,315.550	
NETAPP INC	28,265	77.050	2,177,818.250	
NEWMONT CORP	116,853	39.110	4,570,120.830	
NVR INC	462	6,178.660	2,854,540.920	
NIKE INC-CL B	171,651	98.650	16,933,371.150	
NORDSON CORP	7,548	227.900	1,720,189.200	
NORFOLK SOUTHERN CORP	31,049	202.000	6,271,898.000	
EVERSOURCE ENERGY	43,648	58.970	2,573,922.560	
NISOURCE INC	53,270	26.050	1,387,683.500	
NORTHERN TRUST CORP	26,127	68.350	1,785,780.450	
NORTHROP GRUMMAN CORP	20,050	473.370	9,491,068.500	
WELLS FARGO & CO	511,449	39.690	20,299,410.810	
NUCOR CORP	36,511	154.860	5,654,093.460	
CHENIERE ENERGY INC	33,140	172.390	5,713,004.600	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	55,081	97.120	5,349,466.720	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	92,600	63.350	5,866,210.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,116	425.760	6,010,028.160	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,365	916.410	7,665,769.650	
ORACLE CORP	227,161	109.640	24,905,932.040	

PACCAR INC	75,017	86.680	6,502,473.560	
PTC INC	15,968	143.520	2,291,727.360	
EXELON CORP	144,751	40.040	5,795,830.040	
PARKER HANNIFIN CORP	17,358	407.290	7,069,739.820	
PAYCHEX INC	47,024	118.660	5,579,867.840	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,597	277.520	2,940,879.440	
PPL CORPORATION	102,363	24.110	2,467,971.930	
PEPSICO INC	192,723	162.620	31,340,614.260	
PENTAIR PLC	19,459	65.600	1,276,510.400	
PFIZER INC	787,990	33.110	26,090,348.900	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	34.230	1,122,607.080	
CONOCOPHILLIPS	169,323	120.040	20,325,532.920	
PG&E CORP	259,254	16.040	4,158,434.160	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	32,251	240.820	7,766,685.820	
ALTRIA GROUP INC	249,953	42.560	10,637,999.680	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	54,185	122.740	6,650,666.900	
BROWN & BROWN INC	35,984	71.460	2,571,416.640	
GARMIN LTD	19,735	108.730	2,145,786.550	
PPG INDUSTRIES INC	33,760	132.520	4,473,875.200	
COSTCO WHOLESALE CORP	61,929	565.520	35,022,088.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	31,190	104.150	3,248,438.500	
QUEST DIAGNOSTICS	16,598	122.730	2,037,072.540	
PROCTER & GAMBLE CO	329,495	143.000	47,117,785.000	
PROGRESSIVE CORP	81,318	143.860	11,698,407.480	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	67,402	60.770	4,096,019.540	
PULTE GROUP INC	32,561	75.590	2,461,285.990	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,196	115.180	4,284,235.280	
QUALCOMM INC	155,257	111.120	17,252,157.840	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,105	100.150	2,914,865.750	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	66.890	1,742,150.050	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	7,931	263.250	2,087,835.750	
REGENERON PHARMACEUTICALS	14,964	836.070	12,510,951.480	
REPLIGEN CORP	6,730	156.350	1,052,235.500	
RESMED INC	18,645	144.230	2,689,168.350	
US BANCORP	220,548	32.510	7,170,015.480	
SEAGEN INC	20,184	214.500	4,329,468.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	49,747	83.020	4,129,995.940	
ROSS STORES INC	46,277	113.670	5,260,306.590	
ROLLINS INC	36,205	36.320	1,314,965.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	15,293	502.030	7,677,544.790	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,478	299.920	4,642,161.760	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	31,833	89.200	2,839,503.600	

RPM INTERNATIONAL INC	19,169	99.610	1,909,424.090	
ACCENTURE PLC-CL A	88,144	312.540	27,548,525.760	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	188,870	62.900	11,879,923.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,309	210.600	3,013,475.400	
AXON ENTERPRISE INC	10,996	220.000	2,419,120.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	33,616	162.410	5,459,574.560	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	80,075	53.120	4,253,584.000	
BOOKING HOLDINGS INC	5,130	3,071.950	15,759,103.500	
SCHLUMBERGER LTD	197,675	58.760	11,615,383.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	208,292	51.910	10,812,437.720	
POOL CORP	5,406	351.370	1,899,506.220	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	27,528	105.350	2,900,074.800	
BUNGE LTD	21,715	101.990	2,214,712.850	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	57.860	837,639.220	
ELEVANCE HEALTH INC	33,024	453.570	14,978,695.680	
CENCORA INC	23,804	188.030	4,475,866.120	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,327	70.650	2,495,852.550	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	34,934	255.540	8,927,034.360	
CENTENE CORP	78,244	70.980	5,553,759.120	
SMITH (A.O.) CORP	19,467	71.090	1,383,909.030	
SNAP-ON INC	6,590	261.210	1,721,373.900	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	49,426	94.860	4,688,550.360	
EDISON INTERNATIONAL	50,343	64.930	3,268,770.990	
SOUTHERN CO	156,515	67.100	10,502,156.500	
TRUIST FINANCIAL CORP	191,230	29.610	5,662,320.300	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	26.200	516,140.000	
AT&T INC	997,667	14.770	14,735,541.590	
CHEVRON CORP	253,806	161.100	40,888,146.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,889	84.070	1,924,278.230	
STATE STREET CORP	44,619	65.300	2,913,620.700	
STARBUCKS CORP	159,737	91.950	14,687,817.150	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	110.490	2,534,309.130	
STRYKER CORP	47,631	260.050	12,386,441.550	
NETFLIX INC	61,934	365.930	22,663,508.620	
GEN DIGITAL INC	89,004	17.730	1,578,040.920	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	19,152	48.950	937,490.400	
SYNOPSYS INC	21,045	494.950	10,416,222.750	
SYSCO CORP	72,334	64.080	4,635,162.720	
INTUITIVE SURGICAL INC	48,608	281.790	13,697,248.320	
TELEFLEX INC	6,985	192.230	1,342,726.550	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	9.040	1,530,020.000	
TERADYNE INC	22,066	99.560	2,196,890.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	126,747	157.330	19,941,105.510	
TEXTRON INC	26,006	79.760	2,074,238.560	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	53,835	492.630	26,520,736.050	
GLOBE LIFE INC	12,153	113.300	1,376,934.900	
TORO CO	14,644	86.090	1,260,701.960	
DAVITA INC	6,813	75.890	517,038.570	
TRACTOR SUPPLY CO	14,379	204.310	2,937,773.490	
BIO-TECHNE CORP	19,606	69.290	1,358,499.740	
TRIMBLE INC	36,251	52.530	1,904,265.030	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,996	392.420	2,352,950.320	
TYSON FOODS INC	41,316	48.210	1,991,844.360	
MARATHON OIL CORP	76,035	26.490	2,014,167.150	
UNION PACIFIC CORP	85,044	209.480	17,815,017.120	
RTX CORP	203,018	73.310	14,883,249.580	
UNITEDHEALTH GROUP INC	130,051	524.130	68,163,630.630	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	127.020	1,028,353.920	
VF CORP	51,762	16.160	836,473.920	
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	12.140	954,968.820	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	35,537	365.250	12,979,889.250	
VULCAN MATERIALS CO	17,433	214.760	3,743,911.080	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,661	22.600	2,433,138.600	
WALMART INC	207,453	158.230	32,825,288.190	
WASTE MANAGEMENT INC	56,297	156.680	8,820,613.960	
WATERS CORP	8,441	266.200	2,246,994.200	
WATSCO INC	4,889	402.720	1,968,898.080	
WEBSTER FINANCIAL CORP	21,109	39.990	844,148.910	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,639	392.210	4,172,722.190	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,386	114.730	1,765,235.780	
VAIL RESORTS INC	5,235	215.870	1,130,079.450	
WESTERN DIGITAL CORP	47,864	46.390	2,220,410.960	
WABTEC CORP	22,016	105.740	2,327,971.840	
WHIRLPOOL CORP	6,832	128.160	875,589.120	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	97.880	2,176,361.800	
WYNN RESORTS LTD	15,379	94.730	1,456,852.670	
NASDAQ INC	47,600	49.660	2,363,816.000	
CME GROUP INC	49,920	217.100	10,837,632.000	
WILLIAMS COS INC	174,840	34.690	6,065,199.600	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	108.710	929,579.210	
LKQ CORP	37,072	50.920	1,887,706.240	
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	49.690	1,687,770.540	

WEC ENERGY GROUP INC	41,287	82.950	3,424,756.650	
CARMAX INC	22,414	69.100	1,548,807.400	
TJX COMPANIES INC	159,850	89.250	14,266,612.500	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,764	217.160	1,686,030.240	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.470	541,490.030	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	42.920	1,009,821.760	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,146	167.820	2,877,441.720	
CBRE GROUP INC	45,160	73.850	3,335,066.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	133,681	16.490	2,204,399.690	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	354.050	1,818,754.850	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,578	502.040	3,302,419.120	
WESTLAKE CORP	6,030	125.130	754,533.900	
T-MOBILE US INC	74,866	143.120	10,714,821.920	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	46.520	2,224,586.400	
MOSAIC CO/THE	48,502	36.130	1,752,377.260	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	236.590	1,152,429.890	
CELANESE CORP	12,876	124.090	1,597,782.840	
DEXCOM INC	55,631	78.970	4,393,180.070	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	16,634	125.690	2,090,727.460	
EXPEDIA GROUP INC	18,344	103.610	1,900,621.840	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	25,892	84.000	2,174,928.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,506	329.340	4,777,406.040	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	18.020	649,332.680	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	82,389	111.450	9,182,254.050	
LIVE NATION	21,189	87.610	1,856,368.290	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,791	1,823.480	6,912,812.680	
TRANSDIGM GROUP INC	7,547	869.000	6,558,343.000	
MASTERCARD INC	118,296	399.810	47,295,923.760	
OWENS CORNING	13,227	136.560	1,806,279.120	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	95.640	1,727,354.040	
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	61.840	1,507,597.360	
FIRST SOLAR INC	14,780	151.500	2,239,170.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,337	182.390	3,162,095.430	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,308	308.860	2,257,148.880	
AECOM TECHNOLOGY CORP	17,000	83.780	1,424,260.000	
DELTA AIR LINES INC	21,592	35.980	776,880.160	
INSULET CORP	10,158	133.450	1,355,585.100	
DISCOVER FINANCIAL	35,918	90.760	3,259,917.680	
TE CONNECTIVITY LTD	45,141	125.430	5,662,035.630	
LULULEMON ATHLETICA INC	16,679	373.360	6,227,271.440	

VMWARE INC	34,158	171.480	5,857,413.840	
MERCADOLIBRE INC	6,207	1,243.950	7,721,197.650	
ULTA BEAUTY INC	7,466	391.300	2,921,445.800	
INVESCO LTD	57,267	13.810	790,857.270	
MSCI INC	11,575	523.170	6,055,692.750	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	217,190	93.150	20,231,248.500	
VISA INC	226,104	235.680	53,288,190.720	
KEURIG DR PEPPER INC	130,795	29.290	3,830,985.550	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,490	122.220	3,482,047.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	58,937	148.520	8,753,323.240	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	62.470	1,010,889.540	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	279,350	16.850	4,707,047.500	
XYLEM INC	33,760	92.370	3,118,411.200	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,537	93.540	3,511,210.980	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,330	220.300	1,394,499.000	
SPLUNK INC	23,372	147.180	3,439,890.960	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	248.920	2,031,685.040	
HCA HEALTHCARE INC	28,711	244.070	7,007,493.770	
VERISK ANALYTICS INC	20,276	245.510	4,977,960.760	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,533	129.990	1,369,184.670	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,298	256.240	2,638,759.520	
NXP SEMICONDUCTOR NV	35,299	203.460	7,181,934.540	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,741	126.650	2,500,197.650	
TARGA RESOURCES CORP	27,732	85.500	2,371,086.000	
LEAR CORP	9,620	139.250	1,339,585.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,261	161.580	2,465,872.380	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,899	52.760	1,841,271.240	
DOLLAR GENERAL CORP	29,298	103.660	3,037,030.680	
FORTINET INC	90,920	58.970	5,361,552.400	
HYATT HOTELS CORP	6,647	108.290	719,803.630	
TESLA INC	398,105	262.990	104,697,633.950	
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	107.780	981,983.580	
ENPHASE ENERGY INC	18,723	128.610	2,407,965.030	
GENERAL MOTORS CO	191,495	30.980	5,932,515.100	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	25.410	996,834.300	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	10,655	233.380	2,486,663.900	
APTIV PLC	38,007	98.920	3,759,652.440	
PHILLIPS 66	64,680	112.130	7,252,568.400	
META PLATFORMS INC	308,773	327.820	101,221,964.860	

IQVIA HOLDINGS INC	26,820	204.560	5,486,299.200	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,714	158.850	3,925,818.900	
SERVICENOW INC	28,267	558.670	15,791,924.890	
PALO ALTO NETWORKS INC	42,240	259.210	10,949,030.400	
WORKDAY INC	29,552	222.000	6,560,544.000	
ABBVIE INC	246,089	149.340	36,750,931.260	
ZOETIS INC	64,279	176.950	11,374,169.050	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	20.900	1,133,009.900	
CDW CORP	17,900	213.820	3,827,378.000	
HOWMET AEROSPACE INC	55,049	46.470	2,558,127.030	
TWILIO INC	25,710	57.420	1,476,268.200	
SNAP INC	152,250	9.110	1,386,997.500	
TRADE DESK INC A	60,797	84.770	5,153,761.690	
OKTA INC	21,831	87.970	1,920,473.070	
BAKER HUGHES CO	146,676	34.900	5,118,992.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,514	91.840	1,975,845.760	
BROADCOM INC	57,542	874.560	50,323,931.520	
ARES MANAGEMENT CORP	23,111	111.140	2,568,556.540	
MONGODB INC	10,029	365.220	3,662,791.380	
BURLINGTON STORES INC	8,453	123.610	1,044,875.330	
VEEVA SYSTEMS INC	20,611	216.720	4,466,815.920	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	37.740	941,160.120	
EVERGY INC	33,192	50.300	1,669,557.600	
ALLEGION PLC	13,423	105.970	1,422,435.310	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	22,274	75.110	1,673,000.140	
STERIS PLC	14,147	225.000	3,183,075.000	
DOCUSIGN INC	26,362	42.230	1,113,267.260	
WIX.COM LTD	8,997	85.820	772,122.540	
DROPBOX INC	32,221	28.220	909,276.620	
KKR & CO INC	82,021	63.100	5,175,525.100	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	63.950	322,947.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	64.820	2,194,610.740	
MODERNA INC	47,242	102.760	4,854,587.920	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	37,524	153.690	5,767,063.560	
ARAMARK	29,717	26.320	782,151.440	
CIGNA GROUP	41,015	294.450	12,076,866.750	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,670	70.340	2,720,047.800	
DOW INC	101,691	50.890	5,175,054.990	
OVINTIV INC	39,779	48.620	1,934,054.980	
AMCOR PLC	187,204	8.950	1,675,475.800	
PINTEREST INC	79,624	28.460	2,266,099.040	
FOX CORP-A	36,501	31.190	1,138,466.190	
FOX CORP-B	28,295	28.810	815,178.950	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	6.780	288,733.080	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	30,263	188.220	5,696,101.860	
CHEWY INC	9,648	18.790	181,285.920	

AVANTOR INC	97,157	20.950	2,035,439.150	
DYNATRACE INC	32,648	48.180	1,572,980.640	
CLOUDFLARE INC	39,882	65.290	2,603,895.780	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	83.140	1,147,332.000	
CARRIER GLOBAL CORP	119,861	56.040	6,717,010.440	
OTIS WORLDWIDE CORP	59,624	81.040	4,831,928.960	
UBER TECHNOLOGIES INC	252,413	46.640	11,772,542.320	
CORTEVA INC	102,288	49.880	5,102,125.440	
MATCH GROUP INC	42,058	38.320	1,611,662.560	
FERGUSON PLC	29,638	169.570	5,025,715.660	
BILL HOLDINGS INC	14,365	114.610	1,646,372.650	
BLACKSTONE INC	97,713	107.270	10,481,673.510	
PAYLOCITY HOLDING CORP	7,378	205.050	1,512,858.900	
CARLYLE GROUP INC	34,847	30.410	1,059,697.270	
DATADOG INC	35,218	89.440	3,149,897.920	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	69.560	1,786,926.840	
INGERSOLL RAND INC	51,111	65.990	3,372,814.890	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	58,669	67.780	3,976,584.820	
PAYCOM SOFTWARE INC	6,479	278.090	1,801,745.110	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	19.370	1,809,661.620	
DRAFTKINGS INC	53,576	30.740	1,646,926.240	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	30.270	933,496.530	
AON PLC	28,690	327.320	9,390,810.800	
WARNER BROS DISCOVERY INC	310,364	10.960	3,401,589.440	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,847.550	1,673,880.300	
BENTLEY SYSTEMS INC	26,659	53.710	1,431,854.890	
COINBASE GLOBAL INC	23,696	77.350	1,832,885.600	
UIPATH INC	53,439	17.020	909,531.780	
AIRBNB INC	56,873	130.000	7,393,490.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP	44,942	115.070	5,171,475.940	
MONDAY.COM LTD	3,043	148.070	450,577.010	
ROYALTY PHARMA PLC	47,149	27.140	1,279,623.860	
ROBLOX CORP	59,573	31.760	1,892,038.480	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	17.500	733,320.000	
VIATRIS INC	186,021	9.690	1,802,543.490	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	33,177	47.010	1,559,650.770	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	88.200	1,397,617.200	
HF SINCLAIR CORP	20,299	54.090	1,097,972.910	
SNOWFLAKE INC	35,393	163.540	5,788,171.220	
DOORDASH INC	37,045	80.800	2,993,236.000	
ARISTA NETWORKS INC	35,798	191.860	6,868,204.280	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	55,400	89.290	4,946,666.000	

GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	35.640	566,426.520	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	254,570	17.920	4,561,894.400	
FNF GROUP	38,907	39.890	1,552,000.230	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,941	140.350	2,658,369.350	
MARVELL TECHNOLOGY INC	117,012	55.140	6,452,041.680	
APA CORP	40,946	38.930	1,594,027.780	
CONFLUENT INC	27,524	31.500	867,006.000	
LINDE PLC	68,457	378.670	25,922,612.190	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	9.720	715,061.520	
LUCID GROUP INC	143,927	5.340	768,570.180	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	52.250	626,007.250	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	204.830	762,172.430	
TOAST INC	45,399	18.810	853,955.190	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.490	975,507.350	
CATALENT INC	27,357	46.570	1,274,015.490	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,847	29.660	1,597,102.020	
VERALTO CORP	32,610	74.470	2,428,466.700	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	19,871	25.980	516,248.580	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE	28,191	68.590	1,933,620.690	
KENVUE INC	218,684	19.570	4,279,645.880	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	71,856	26.750	1,922,148.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	163.770	857,663.490	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,504	132.920	3,389,991.680	
HUBSPOT INC	6,653	455.450	3,030,108.850	
QORVO INC	14,144	93.420	1,321,332.480	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,513	93.070	1,723,004.910	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	7,789	124.540	970,042.060	
GODADDY INC	19,713	76.400	1,506,073.200	
ETSY INC	18,558	64.840	1,203,300.720	
TRANSUNION	24,667	71.720	1,769,117.240	
ALBERTSONS COS INC	40,041	22.720	909,731.520	
BLOCK INC	78,232	46.690	3,652,652.080	
DUPONT DE NEMOURS INC	62,713	76.420	4,792,527.460	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,108	58.430	1,817,640.440	
WESTROCK CO	34,286	37.280	1,278,182.080	
KRAFT HEINZ CO	114,528	32.440	3,715,288.320	
FORTIVE CORP	49,865	77.160	3,847,583.400	
WASTE CONNECTIONS INC	34,595	138.030	4,775,147.850	
ALPHABET INC-CL A	827,386	140.550	116,289,102.300	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	188,508	17.160	3,234,797.280	

	PAYPAL HOLDINGS INC	146,445	58.070	8,504,061.150	
	SEA LTD ADR	50,316	44.390	2,233,527.240	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	41,786	28.290	1,182,125.940	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	45.040	1,007,724.960	
	ALPHABET INC-CL C	740,563	141.700	104,937,777.100	
	ZSCALER INC	12,304	173.050	2,129,207.200	
	ATLASSIAN CORP PLC	21,763	199.450	4,340,630.350	
	ROKU INC	15,660	71.360	1,117,497.600	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,512	449.820	6,077,967.840	
	VISTRA CORP	49,633	32.770	1,626,473.410	
アメリカ・ドル　小計		47,810,389		5,304,508,632.700 (791,750,958,517)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	14.385	881,728.570	
	ASHTEAD GROUP	63,076	50.380	3,177,768.880	
	SEVERN TRENT PLC	27,019	24.220	654,400.180	
	BARCLAYS PLC	2,207,571	1.571	3,468,094.040	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.298	533,794.400	
	BT GROUP PLC	904,198	1.196	1,081,420.800	
	BUNZL PLC	46,691	30.090	1,404,932.190	
	CRH PLC	102,020	47.060	4,801,061.200	
	AVIVA PLC	344,901	4.096	1,412,714.490	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	45.440	934,837.120	
	DIAGEO PLC	323,409	30.970	10,015,976.730	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.036	445,437.170	
	DCC PLC	16,599	46.360	769,529.640	
	NATIONAL GRID PLC	504,761	9.686	4,889,115.040	
	KINGFISHER PLC	323,222	2.124	686,523.520	
	BAE SYSTEMS PLC	418,384	10.540	4,409,767.360	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	294,881	25.425	7,497,349.420	
	HALMA PLC	51,066	19.450	993,233.700	
	NEXT PLC	16,093	68.760	1,106,554.680	
	IMPERIAL BRANDS PLC	125,526	17.550	2,202,981.300	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	15.550	310,626.800	
	ANGLO AMERICAN PLC	169,158	22.705	3,840,732.390	
	COMPASS GROUP PLC	235,947	20.820	4,912,416.540	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,743,184	6.590	18,077,582.560	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.201	1,884,934.190	
	CENTRICA PLC	793,776	1.563	1,240,671.880	
	UNILEVER PLC	351,404	39.305	13,811,934.220	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	9.742	882,323.190	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	53,779	19.670	1,057,832.930	
	PEARSON PLC	84,159	9.036	760,460.720	
	PERSIMMON PLC	56,474	10.620	599,753.880	

PRUDENTIAL PLC	399,036	9.078	3,622,448.800	
RIO TINTO PLC	155,039	50.550	7,837,221.450	
VODAFONE GROUP PLC	3,279,277	0.775	2,541,439.670	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	103,199	59.000	6,088,741.000	
RELX PLC	262,540	29.000	7,613,660.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	363,315	6.048	2,197,329.120	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,235,225	2.131	2,632,264.470	
NATWEST GROUP PLC	746,475	2.292	1,710,920.700	
ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	8.200	730,472.400	
SSE PLC	158,403	15.875	2,514,647.620	
BP PLC	2,420,400	5.203	12,593,341.200	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	10.010	1,523,481.960	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.435	849,607.320	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	89.400	961,139.400	
STANDARD CHARTERED PLC	309,012	7.582	2,342,928.980	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,257,724	0.432	3,999,336.760	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.167	665,030.120	
TESCO PLC	1,032,016	2.811	2,900,996.970	
3I GROUP PLC	143,794	20.570	2,957,842.580	
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	9.442	1,189,031.060	
GSK PLC	580,157	15.192	8,813,745.140	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	57,829	82.660	4,780,145.140	
WPP PLC	142,785	7.464	1,065,747.240	
ASTRAZENECA PLC	215,917	109.440	23,629,956.480	
WHITBREAD PLC	25,470	33.490	852,990.300	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.230	984,339.070	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	17.770	928,109.330	
INTERCONTINENTAL HOTELS	19,700	60.700	1,195,790.000	
SAINSBURY (J) PLC	159,205	2.581	410,908.100	
ADMIRAL GROUP PLC	32,350	24.010	776,723.500	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	41.390	682,479.710	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	20.790	383,679.450	
ABRDN PLC	285,831	1.640	468,762.840	
EXPERIAN PLC	130,915	27.830	3,643,364.450	
MONDI PLC	74,310	13.940	1,035,881.400	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.760	286,669.920	
OCADO GROUP PLC	69,766	5.876	409,945.010	
INFORMA PLC	186,195	7.276	1,354,754.820	
GLENCORE PLC	1,454,559	4.613	6,709,880.660	
ENTAIN PLC	96,924	9.466	917,482.580	
COCA-COLA HBC AG	31,035	21.470	666,321.450	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,323	4.713	241,885.290	
M&G PLC	270,401	2.011	543,776.410	

	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	15.770	442,742.750	
	WISE PLC	96,207	7.202	692,882.810	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.386	529,550.400	
	HALEON PLC	743,306	3.353	2,492,305.010	
	SHELL PLC	934,420	26.460	24,724,753.200	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	6.454	924,135.350	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	221,854	4.733	1,050,034.980	
イギリス・ポンド　小計		38,986,861		257,858,114.100 (47,394,321,372)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	29.990	5,620,245.960	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	228,914	27.680	6,336,339.520	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	838.300	2,791,539.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.240	2,972,098.560	
	ICL GROUP LTD	103,067	20.900	2,154,100.300	
	NICE LTD	9,053	635.000	5,748,655.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	26,490	127.400	3,374,826.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	179.100	836,755.200	
イスラエル・シュケル　小計		725,874		29,834,559.540 (1,125,058,257)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	51.190	1,448,984.140	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	502,599	21.440	10,775,722.560	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	234,609	21.160	4,964,326.440	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.900	2,339,426.700	
	ASX LTD	31,066	57.640	1,790,644.240	
	BHP GROUP LTD	702,987	44.730	31,444,608.510	
	AMPOL LTD	31,828	32.070	1,020,723.960	
	COMPUTERSHARE LT	69,013	25.820	1,781,915.660	
	CSL LIMITED	66,595	254.270	16,933,110.650	
	REA GROUP LTD	6,134	164.060	1,006,344.040	
	TRANSURBAN GROUP	450,346	12.720	5,728,401.120	
	COCHLEAR LTD	7,969	259.240	2,065,883.560	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	9.210	2,373,343.320	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	233,216	100.640	23,470,858.240	
	RIO TINTO LIMITED	54,047	113.790	6,150,008.130	
	APA GROUP	164,300	8.310	1,365,333.000	
	ARISTOCRAT LEISU	89,945	40.880	3,676,951.600	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.530	1,991,253.460	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	41.580	2,526,691.860	
	IGO LTD	91,947	11.460	1,053,712.620	
	ORICA LTD	63,862	15.640	998,801.680	
	LEND LEASE CORP LTD	107,181	6.910	740,620.710	
	BLUESCOPE STEEL LTD	75,503	19.530	1,474,573.590	

	MACQUARIE GROUP LTD	50,207	169.940	8,532,177.580	
	SUNCORP GROUP LTD	158,081	13.730	2,170,452.130	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	447,363	29.290	13,103,262.270	
	NEWCREST MINING LTD	126,686	25.280	3,202,622.080	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.030	566,674.770	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	215,572	15.770	3,399,570.440	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	11.260	1,831,202.540	
	REECE LTD	31,558	18.600	586,978.800	
	SANTOS LTD	485,603	7.750	3,763,423.250	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	30.170	1,957,942.490	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	34.020	884,009.700	
	WESFARMERS LTD	155,701	52.660	8,199,214.660	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	262,185	35.910	9,415,063.350	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	169,400	37.920	6,423,648.000	
	SEEK LTD	35,880	22.740	815,911.200	
	MINERAL RESOURCES LTD	28,198	61.720	1,740,380.560	
	BRAMBLES LTD	170,377	14.320	2,439,798.640	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	4.040	1,634,163.840	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.670	817,855.830	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	87,104	11.780	1,026,085.120	
	XERO LTD	17,754	119.740	2,125,863.960	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	22.700	1,019,752.100	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.810	1,401,008.700	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.320	1,242,964.800	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	430,039	25.650	11,030,500.350	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.510	1,448,756.010	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	3.430	2,046,660.420	
	COLES GROUP LTD	203,490	15.670	3,188,688.300	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	64.800	1,380,888.000	
オーストラリア・ドル　小計		9,959,148		224,517,759.680 (21,504,311,022)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	67,555	64.640	4,366,755.200	
	BARRICK GOLD CORP	239,565	20.690	4,956,599.850	
	BANK OF MONTREAL	99,353	112.100	11,137,471.300	
	BANK OF NOVA SCOTIA	166,984	60.530	10,107,541.520	
	NATIONAL BANK OF CANADA	44,531	89.460	3,983,743.260	
	BCE INC	14,197	52.220	741,367.340	
	BROOKFIELD CORP	204,437	45.320	9,265,084.840	
	SAPUTO INC	34,582	28.020	968,987.640	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	8.100	747,719.100	

DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	101.250	1,165,185.000	
CGI INC	31,363	137.990	4,327,780.370	
CCL INDUSTRIES INC	21,058	56.660	1,193,146.280	
CAE INC	40,808	31.750	1,295,654.000	
CAMECO CORP	58,355	50.600	2,952,763.000	
ROGERS COMM-CL B	53,428	54.250	2,898,469.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	131,160	51.890	6,805,892.400	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	153,634	88.570	13,607,363.380	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,857	143.560	1,271,510.920	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	30.110	491,696.300	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	80,815	148.390	11,992,137.850	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	40.160	871,994.080	
OPEN TEXT CORP	40,459	49.000	1,982,491.000	
EMPIRE CO LTD	20,608	37.820	779,394.560	
KINROSS GOLD CORP	193,561	6.700	1,296,858.700	
RB GLOBAL INC	26,641	91.600	2,440,315.600	
FORTIS INC	71,759	55.390	3,974,731.010	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	31.500	2,690,761.500	
TELUS CORP	31,890	22.920	730,918.800	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	38.960	1,332,743.680	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	81.950	2,232,809.700	
ENBRIDGE INC	296,376	44.610	13,221,333.360	
IGM FINANCIAL INC	12,478	34.400	429,243.200	
MANULIFE FINANCIAL CORP	265,111	25.520	6,765,632.720	
LOBLAW CO LTD	21,229	116.110	2,464,899.190	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	112,792	74.340	8,384,957.280	
MAGNA INTERNATIONAL INC	34,858	74.260	2,588,555.080	
SUN LIFE FINANCIAL INC	81,434	67.600	5,504,938.400	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,229	1,139.520	3,679,510.080	
METRO INC	27,929	72.370	2,021,221.730	
EMERA INC	36,998	48.750	1,803,652.500	
ONEX CORP	10,157	81.360	826,373.520	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	19.800	1,096,385.400	
POWER CORP OF CANADA	87,955	35.230	3,098,654.650	
QUEBECOR INC-B	17,195	29.670	510,175.650	
ROYAL BANK OF CANADA	194,165	116.380	22,596,922.700	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	128,591	99.740	12,825,666.340	
STANTEC INC	11,917	91.080	1,085,400.360	
SUNCOR ENERGY INC	181,890	45.880	8,345,113.200	
LUNDIN MINING CORP	77,139	9.760	752,876.640	
TECK RESOURCES LTD-CL B	66,934	55.940	3,744,287.960	
THOMSON REUTERS CORP	22,378	173.570	3,884,149.460	

	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,166	112.020	1,026,775.320	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	256,201	81.420	20,859,885.420	
	TC ENERGY CORP	148,310	47.670	7,069,937.700	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	92.950	753,080.900	
	WESTON (GEORGE) LTD	9,839	150.850	1,484,213.150	
	INTACT FINANCIAL CORP	23,992	200.700	4,815,194.400	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	55,704	56.450	3,144,490.800	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,768	2,870.460	7,945,433.280	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	25,662	186.050	4,774,415.100	
	TOURMALINE OIL CORP	46,466	69.130	3,212,194.580	
	KEYERA CORP	39,467	32.840	1,296,096.280	
	PARKLAND CORP	15,665	39.760	622,840.400	
	ALTAGAS LTD	33,833	27.110	917,212.630	
	PEMBINA PIPELINE CORP	81,652	41.360	3,377,126.720	
	DOLLARAMA INC	41,354	96.480	3,989,833.920	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	202,950	27.850	5,652,157.500	
	ARC RESOURCES LTD	78,639	21.670	1,704,107.130	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	22.760	777,299.520	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	19.710	1,009,999.530	
	TMX GROUP LTD	35,200	30.500	1,073,600.000	
	BRP INC	4,307	107.820	464,380.740	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	11.290	1,115,677.800	
	NUTRIEN LTD	71,801	82.580	5,929,326.580	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	171.230	1,984,726.930	
	WSP GLOBAL INC	17,782	196.310	3,490,784.420	
	IA FINANCIAL CORP INC	16,448	85.470	1,405,810.560	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	44.040	1,570,774.680	
	NUVEI CORP	7,929	21.520	170,632.080	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	32.700	526,568.100	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	45.580	2,381,509.420	
	AIR CANADA	14,871	18.780	279,277.380	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	41,208	87.740	3,615,589.920	
	SHOPIFY INC	165,173	73.720	12,176,553.560	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	201.040	1,052,846.480	
	HYDRO ONE LTD	46,225	36.260	1,676,118.500	
カナダ・ドル　小計		5,676,241		331,586,308.030 (36,428,071,800)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.870	664,866.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	4.880	791,536.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	259,510	33.720	8,750,677.200	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	28,400	6.720	190,848.000	
	SEATRIUM LTD	7,235,222	0.128	926,108.410	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	30.490	472,595.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	95,700	9.900	947,430.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.840	639,402.120	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.660	1,231,434.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	459,198	13.000	5,969,574.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,092,930	2.440	2,666,749.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.400	1,561,600.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	183,066	28.500	5,217,381.000	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.530	284,708.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.730	964,205.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	431,290	3.130	1,349,937.700	
シンガポール・ドル　小計		11,627,009		32,629,051.630 (3,573,860,025)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	64.120	1,521,824.080	
	NESTLE SA-REGISTERED	373,312	105.160	39,257,489.920	
	CIE FINANC RICHEMONT	72,123	109.300	7,883,043.900	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	97,873	254.050	24,864,635.650	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	186.200	988,908.200	
	SIKA INHABER	21,046	234.600	4,937,391.600	
	SGS SA-REG	23,250	78.640	1,828,380.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	286,738	89.680	25,714,663.840	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	129.500	754,985.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,440.000	662,400.000	
	CLARIANT AG-REG	23,316	13.590	316,864.440	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	548.000	1,880,188.000	
	ABB LTD	219,922	33.380	7,340,996.360	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	37.000	734,154.000	
	GEBERIT AG	4,211	462.600	1,948,008.600	
	LONZA GROUP AG-REG	10,006	432.200	4,324,593.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	9,900.000	1,356,300.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	98,200.000	1,571,200.000	
	GIVAUDAN-REG	1,257	2,892.000	3,635,244.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	21,465	427.400	9,174,141.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	273.200	1,314,092.000	
	HOLCIM LTD	70,371	58.040	4,084,332.840	
	TEMENOS GROUP	7,082	64.460	456,505.720	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	71.750	335,287.750	
	SONOVA HOLDING AG	6,685	219.200	1,465,352.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	261.800	2,065,602.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,536	118.500	1,959,516.000	

	THE SWATCH GROUP AG-B	4,157	234.400	974,400.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	44.650	413,414.350	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	129.100	633,364.600	
	SCHINDLER NAMEN	4,276	180.800	773,100.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,848	582.800	2,242,614.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	98.700	483,926.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	618.000	500,580.000	
	SWISS PRIME SITE AG	9,861	85.700	845,087.700	
	DUFRY GROUP	12,933	32.010	413,985.330	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,369	1,046.500	3,525,658.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,558	59.340	1,516,611.720	
	SWISS RE LTD	41,653	97.280	4,052,003.840	
	BKW AG	3,194	159.000	507,846.000	
	SIG GROUP AG	38,322	21.700	831,587.400	
	ALCON INC	72,016	68.040	4,899,968.640	
	SANDOZ GROUP AG	57,347	25.760	1,477,258.720	
	UBS GROUP AG	455,603	22.690	10,337,632.070	
	VAT GROUP AG	4,053	334.800	1,356,944.400	
スイス・フラン　小計		2,087,395		188,162,085.470 (31,161,522,975)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	382,550	150.650	57,631,157.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	196,242	132.000	25,903,944.000	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	53.320	22,287,760.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	203.400	5,238,567.000	
	LUNDBERGS B	14,161	469.800	6,652,837.800	
	SKF AB-B SHS	46,594	184.700	8,605,911.800	
	SANDVIK AB	150,884	201.700	30,433,302.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	134.800	29,972,510.400	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	179.850	7,902,069.450	
	SWEDBANK AB	110,760	207.600	22,993,776.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,465	158.600	14,664,949.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	216,734	99.180	21,495,678.120	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	230.000	5,565,540.000	
	VOLVO AB-B SHS	221,062	227.800	50,357,923.600	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	437.500	4,437,125.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	84.420	5,711,350.680	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	292.600	4,474,439.200	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	291.600	6,218,370.000	
	SAAB AB-B	11,789	578.000	6,814,042.000	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	90.760	6,905,474.600	
	INVESTOR AB-B SHS	246,861	216.950	53,556,493.950	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	79,621	151.280	12,045,064.880	
	ASSA ABLOY AB-B	133,962	247.700	33,182,387.400	
	TELIA CO AB	344,810	23.710	8,175,445.100	

	BOLIDEN AB	36,260	307.750	11,159,015.000	
	ALFA LAVAL AB	44,259	374.200	16,561,717.800	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	50.440	3,679,194.480	
	INDUTRADE AB	39,178	205.000	8,031,490.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	82.800	3,955,273.200	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	70.500	15,004,656.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	17,403	221.000	3,846,063.000	
	HEXAGON AB-B SHS	303,304	98.200	29,784,452.800	
	SAGAX AB	28,022	211.200	5,918,246.400	
	EPIROC AB-A	79,158	210.800	16,686,506.400	
	EPIROC AB-B	61,487	178.300	10,963,132.100	
	ESSITY AB-B	86,900	236.700	20,569,230.000	
	EQT AB	55,194	218.000	12,032,292.000	
	VOLVO CAR AB	63,710	44.650	2,844,651.500	
	BEIJER REF AB	50,493	112.800	5,695,610.400	
	LIFCO AB	39,479	195.500	7,718,144.500	
	EVOLUTION AB	25,280	1,101.000	27,833,280.000	
	NORDEA BANK ABP	457,613	123.560	56,542,662.280	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	196.000	5,417,048.000	
スウェーデン・クローナ　小計		4,922,152		715,468,786.140 (9,794,767,682)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	14,635	908.600	13,297,361.000	
	A P MOLLER A/S	663	12,615.000	8,363,745.000	
	AP MOLLER MAERSK A	520	12,430.000	6,463,600.000	
	DANSKE BANK A/S	101,212	164.550	16,654,434.600	
	GENMAB A/S	9,624	2,487.000	23,934,888.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	291.600	8,688,222.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,675.000	1,462,275.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	454,459	681.800	309,850,146.200	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	140,190	148.060	20,756,531.400	
	COLOPLAST-B	17,884	727.800	13,015,975.200	
	DSV A/S	24,601	1,291.000	31,759,891.000	
	DEMANT A/S	11,367	277.400	3,153,205.800	
	TRYG A/S	44,887	130.100	5,839,798.700	
	PANDORA A/S	12,473	820.000	10,227,860.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	16,295	445.200	7,254,534.000	
	ORSTED A/S	26,911	371.400	9,994,745.400	
デンマーク・クローネ　小計		906,389		490,717,213.300 (10,432,647,955)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.860	1,291,720.260	
	EBOS GROUP LTD	25,631	35.000	897,085.000	
	FISHER & PAYKEL	78,460	21.910	1,719,058.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	4.890	1,071,095.820	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.155	386,743.270	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.200	1,244,401.600	

ニュージーランド・ドル　小計		789,612		6,610,104.550 (593,719,591)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	187.800	10,587,225.000	
	NORSK HYDRO ASA	210,898	62.240	13,126,291.520	
	TELENOR ASA	117,313	120.550	14,142,082.150	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	467.000	5,223,395.000	
	ORKLA ASA	116,068	80.300	9,320,260.400	
	EQUINOR ASA	132,805	360.800	47,916,044.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	397.800	7,889,965.200	
	AKER BP ASA	50,741	304.600	15,455,708.600	
	SALMAR ASA	7,248	544.200	3,944,361.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	157.800	4,058,773.800	
	ADEVINTA ASA	24,382	107.500	2,621,065.000	
	DNB BANK ASA	139,232	218.300	30,394,345.600	
ノルウェー・クローネ　小計		911,802		164,679,517.870 (2,264,343,371)	
ユーロ	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	25,007	159.550	3,989,866.850	
	KERRY GROUP PLC-A	20,033	75.820	1,518,902.060	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	70.880	1,549,436.800	
	UMICORE	34,853	21.990	766,417.470	
	AIR LIQUIDE	73,085	163.300	11,934,780.500	
	AIRBUS SE	82,761	126.320	10,454,369.520	
	AXA SA	260,350	28.560	7,435,596.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	99,848	26.770	2,672,930.960	
	ADIDAS AG	21,616	169.660	3,667,370.560	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	19.045	2,754,154.580	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	184.900	576,888.000	
	DANONE	86,012	54.650	4,700,555.800	
	SAFRAN SA	48,802	152.060	7,420,832.120	
	INTESA SANPAOLO	2,067,102	2.443	5,049,930.180	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	41,014	98.500	4,039,879.000	
	ACCOR SA	29,321	32.190	943,842.990	
	BOUYGUES	29,123	32.390	943,293.970	
	BNP PARIBAS	143,189	60.240	8,625,705.360	
	THALES SA	15,023	139.000	2,088,197.000	
	CAPGEMINI SA	22,114	170.050	3,760,485.700	
	LOTUS BAKERIES NV	30	7,180.000	215,400.000	
	UNICREDIT SPA	266,042	22.950	6,105,663.900	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,755	92.100	1,174,735.500	
	D'IETEREN TRDG	2,736	158.400	433,382.400	
	COMMERZBANK AG	141,036	10.395	1,466,069.220	
	EIFFAGE	11,784	88.600	1,044,062.400	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	25.510	1,500,345.140	
	PUBLICIS GROUPE	33,221	73.340	2,436,428.140	

IBERDROLA SA	847,500	10.635	9,013,162.500	
ENI SPA	334,555	15.086	5,047,096.730	
JERONIMO MARTINS	45,606	20.180	920,329.080	
KESKO OYJ-B	35,252	16.230	572,139.960	
KBC GROUPE	35,962	57.900	2,082,199.800	
HANNOVER RUECK SE	8,405	207.500	1,744,037.500	
WARTSILA OYJ	77,148	10.600	817,768.800	
L'OREAL	33,633	396.800	13,345,574.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	38,454	686.100	26,383,289.400	
GEA GROUP AG	24,987	33.890	846,809.430	
BOLLORE	114,808	5.135	589,539.080	
MEDIOBANCA SPA	86,792	12.190	1,057,994.480	
MICHELIN(CGDE)-B	98,907	29.480	2,915,778.360	
CONTINENTAL AG	17,450	65.560	1,144,022.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	133,895	39.040	5,227,260.800	
OMV AG	23,354	43.770	1,022,204.580	
VERBUND AG	10,663	81.750	871,700.250	
PERNOD-RICARD	27,460	160.300	4,401,838.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	23,311	47.160	1,099,346.760	
RENAULT SA	27,902	37.465	1,045,348.430	
REPSOL SA	167,595	14.525	2,434,317.370	
REMY COINTREAU	2,866	112.600	322,711.600	
MERCK KGAA	18,389	155.500	2,859,489.500	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	60,581	55.040	3,334,378.240	
RWE AG	92,342	34.630	3,197,803.460	
SEB SA	2,596	89.350	231,952.600	
SOCIETE GENERALE-A	104,069	22.600	2,351,959.400	
VINCI S.A.	73,205	105.500	7,723,127.500	
SODEXO	12,910	98.340	1,269,569.400	
SOFINA	2,281	192.200	438,408.200	
SOLVAY SA	11,217	102.750	1,152,546.750	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	75,267	157.260	11,836,488.420	
VIVENDI SE	98,944	8.558	846,762.750	
SAP SE	145,473	124.840	18,160,849.320	
TELEFONICA S.A	750,387	3.867	2,901,746.520	
TOTALENERGIES SE	314,668	61.690	19,411,868.920	
VALEO	26,570	14.345	381,146.650	
E.ON SE	299,003	11.045	3,302,488.130	
VOEST-ALPINE AG	18,032	25.600	461,619.200	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	60.240	805,770.240	
SIEMENS AG-REG	105,449	138.240	14,577,269.760	
UPM-KYMMENE OYJ	77,752	33.630	2,614,799.760	
ING GROEP NV-CVA	489,434	12.862	6,295,100.100	
PUMA AG	11,558	53.740	621,126.920	
BAYER AG	139,086	44.855	6,238,702.530	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	12.405	929,878.800	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	67.920	1,643,052.720	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	110,563	64.850	7,170,010.550	
BASF SE	120,584	42.500	5,124,820.000	
BEIERSDORF AG	12,408	123.150	1,528,045.200	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	72.940	1,574,482.840	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	32,346	32.740	1,059,008.040	
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	394.850	2,626,147.350	
ORANGE	249,830	11.010	2,750,628.300	
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	37.480	2,401,718.400	
RANDSTAD NV	15,584	51.040	795,407.360	
ALLIANZ SE	56,407	226.950	12,801,568.650	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	433,193	3.829	1,658,695.990	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	135,085	28.870	3,899,903.950	
HERMES INTL	4,525	1,751.000	7,923,275.000	
ENDESA S.A.	50,946	19.300	983,257.800	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.294	527,662.540	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	33.160	1,514,947.760	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	18,810	378.800	7,125,228.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,492	23.105	1,420,772.660	
DASSAULT SYSTEMES SA	91,841	37.050	3,402,709.050	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,284	33.530	780,712.520	
RHEINMETALL STAMM	5,596	261.500	1,463,354.000	
HEINEKEN NV	39,116	84.800	3,317,036.800	
AKZO NOBEL	23,353	68.260	1,594,075.780	
ASML HOLDING NV	56,263	567.100	31,906,747.300	
AEGON LTD	232,433	4.650	1,080,813.450	
VOLKSWAGEN AG	3,315	125.000	414,375.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	31,519	109.280	3,444,396.320	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	809,408	7.782	6,298,813.050	
KERING	10,730	427.950	4,591,903.500	
ACCIONA S.A.	4,432	120.600	534,499.200	
FORTUM OYJ	54,194	11.375	616,456.750	
AGEAS	24,086	39.200	944,171.200	
UCB SA	16,732	80.140	1,340,902.480	
NEMETSCHEK SE	9,878	62.980	622,116.440	
CARREFOUR SA	90,116	15.910	1,433,745.560	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.340	465,612.180	
NOKIA OYJ	745,504	3.447	2,569,752.280	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	135,770	18.050	2,450,648.500	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,944	121.300	4,238,707.200	
SANOFI	158,432	103.320	16,369,194.240	
STMICROELECTRONICS NV	99,472	42.380	4,215,623.360	
ELISA OYJ	20,242	45.010	911,092.420	

BANCO SANTANDER SA	2,306,214	3.610	8,325,432.540	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	67,925	15.055	1,022,610.870	
QIAGEN N.V.	34,306	37.710	1,293,679.260	
DEUTSCHE BANK AG-REG	276,499	10.164	2,810,335.830	
BMW VORZUG	7,821	90.350	706,627.350	
ENEL SPA	1,130,734	5.781	6,536,773.250	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	454,011	20.550	9,329,926.050	
SARTORIUS AG	3,651	320.800	1,171,240.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	186,083	32.710	6,086,774.930	
RATIONAL AG	976	593.500	579,256.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	79.540	387,041.640	
BECHTLE AG	14,521	44.880	651,702.480	
KONINKLIJKE KPN NV	504,342	3.157	1,592,207.690	
EUROFINS SCIENTIFIC	17,824	51.940	925,778.560	
TELEPERFORMANCE	7,845	119.350	936,300.750	
DEUTSCHE BOERSE AG	27,549	162.400	4,473,957.600	
EURAZEO	5,673	56.350	319,673.550	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	71.620	925,187.160	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	72.300	1,278,987.000	
INDITEX	158,488	34.620	5,486,854.560	
ESSILORLUXOTTICA	40,566	166.520	6,755,050.320	
SNAM SPA	255,861	4.520	1,156,491.720	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	11.678	1,949,303.430	
ENAGAS	38,270	16.210	620,356.700	
WENDEL	5,449	74.900	408,130.100	
TENARIS SA	73,186	15.285	1,118,648.010	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.271	246,145.500	
TERNA SPA	207,655	7.274	1,510,482.470	
BIOMERIEUX	4,870	90.860	442,488.200	
GRIFOLS SA	31,982	12.040	385,063.280	
NESTE OYJ	56,094	31.020	1,740,035.880	
RECORDATI SPA	17,680	45.260	800,196.800	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	52,583	11.235	590,770.000	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	170.950	1,246,909.300	
KONE OYJ	49,300	39.640	1,954,252.000	
ELIA GROUP	4,078	92.150	375,787.700	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	228.900	882,409.500	
ENGIE	257,314	14.732	3,790,749.840	
ALSTOM	47,494	13.405	636,657.070	
IPSEN SA	5,964	121.500	724,626.000	
ARKEMA SA	6,874	91.240	627,183.760	
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	126.750	379,109.250	
LEGRAND SA	34,487	87.600	3,021,061.200	
AMPLIFON SPA	20,249	27.140	549,557.860	
ADP	3,975	107.900	428,902.500	
ORION OYJ	13,559	39.040	529,343.360	

METSO CORPORATION	106,064	9.730	1,032,002.720	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	14.135	839,703.810	
SYMRISE AG	19,815	92.540	1,833,680.100	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	40,316	31.840	1,283,661.440	
PRYSMIAN SPA	38,343	36.930	1,416,006.990	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	85.500	207,679.500	
CAIXABANK	565,553	3.846	2,175,116.830	
BUREAU VERITAS SA	39,729	23.760	943,961.040	
GETLINK	39,460	14.955	590,124.300	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	14.990	594,923.120	
AMADEUS IT GROUP SA	59,813	57.700	3,451,210.100	
BRENNTAG SE	21,559	71.700	1,545,780.300	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	17.260	426,097.620	
EDENRED	35,618	53.580	1,908,412.440	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	1.713	235,427.860	
TALANX AG	11,451	60.050	687,632.550	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	62.580	745,640.700	
VONOVIA SE	107,034	23.150	2,477,837.100	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	160,579	9.452	1,517,792.700	
KNORR-BREMSE AG	10,342	56.680	586,184.560	
OCI NV	12,329	26.300	324,252.700	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	47.890	1,903,004.930	
FERRARI NV	17,998	291.600	5,248,216.800	
ASR NEDERLAND NV	18,181	36.870	670,333.470	
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	11.420	1,642,675.640	
AIB GROUP PLC	226,914	4.232	960,300.040	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	30.880	534,007.840	
MONCLER SPA	29,763	53.900	1,604,225.700	
NEXI SPA	83,576	5.822	486,579.470	
PROSUS NV	210,283	28.755	6,046,687.660	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	90.120	1,367,480.880	
JDE PEET'S BV	14,385	26.880	386,668.800	
EXOR NV	14,142	85.220	1,205,181.240	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	12.200	913,682.400	
EURONEXT NV	14,089	67.850	955,938.650	
IMCD NV	8,848	117.600	1,040,524.800	
WORLDLINE SA	36,232	24.240	878,263.680	
NN GROUP NV	36,289	31.640	1,148,183.960	
FINECOBANK SPA	93,118	11.065	1,030,350.670	
ARGENX SE	8,116	474.600	3,851,853.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	114,291	25.330	2,894,991.030	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	71,674	31.430	2,252,713.820	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	24.900	244,567.800	
DSM-FIRMENICH AG	24,488	78.360	1,918,879.680	

	ZALANDO SE	31,321	22.160	694,073.360	
	STELLANTIS NV	302,619	18.938	5,730,998.620	
	FERROVIAL SE	75,279	29.220	2,199,652.380	
	AENA SME SA	9,989	139.700	1,395,463.300	
	CELLNEX TELECOM SAU	83,586	30.160	2,520,953.760	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	13.535	715,121.720	
	SCOUT24 SE	10,048	66.020	663,368.960	
	COVESTRO AG	27,558	49.810	1,372,663.980	
	HELLOFRESH SE	17,856	26.420	471,755.520	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	123,927	51.330	6,361,172.910	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.820	578,289.980	
	AMUNDI SA	12,553	53.700	674,096.100	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.630	445,173.770	
	ADYEN NV	3,145	745.300	2,343,968.500	
	DELIVERY HERO SE	22,564	28.485	642,735.540	
ユーロ　小計		24,601,498		632,182,925.250 (100,219,959,140)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	10.760	2,765,320.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	57.200	13,830,731.200	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	37.400	3,489,943.600	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	165,591	292.000	48,352,572.000	
	MTR CORP	287,941	31.100	8,954,965.100	
	HANG SENG BANK LTD	120,396	96.450	11,612,194.200	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	20.800	3,556,217.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	37.700	8,023,314.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.610	8,619,237.660	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	322,904	45.800	14,789,003.200	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	21.600	10,778,292.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	15.080	2,609,835.280	
	SINO LAND CO	659,200	8.750	5,768,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	85.100	17,408,481.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	54.650	2,897,543.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	204,656	74.350	15,216,173.600	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	9.650	1,717,700.000	
	AIA GROUP LTD	1,610,316	68.800	110,789,740.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	8.230	3,811,609.280	
	SANDS CHINA LTD	335,800	22.600	7,589,080.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	12.600	1,764,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	16.120	3,249,792.000	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	29.850	7,645,629.750	
	ESR GROUP LTD	204,800	11.000	2,252,800.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	15.580	4,128,700.000	
	WH GROUP LTD	906,000	4.310	3,904,860.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	41.250	15,239,606.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	41.600	11,073,712.000	
香港・ドル　小計		10,399,069		351,839,054.020 (6,713,089,151)	
合計		159,403,439		1,062,956,630,858 (1,062,956,630,858)	

（２）株式以外の有価証券

2023年10月12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	1,188,920.250	
		GOODMAN GROUP	254,170.000	5,622,240.400	
		GPT GROUP	219,223.000	852,777.470	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	1,001,998.910	
		SCENTRE GROUP	595,674.000	1,501,098.480	
		STOCKLAND	369,843.000	1,434,990.840	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	960,335.200	
	オーストラリア・ドル　小計		2,623,425.000	12,562,361.550 (1,203,222,988)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,424,888.110	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	452,278.000	1,216,627.820	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	749,078.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	555,535.000	
	シンガポール・ドル　小計		2,119,109.000	3,946,128.930 (432,219,502)	
投資信託受益証券　合計			4,742,534	1,635,442,490 (1,635,442,490)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,059.000	2,441,026.140	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,482,099.780	
		AMERICAN TOWER CORP	64,773.000	10,727,704.260	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	76,762.000	1,388,624.580	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,014.000	3,373,463.880	
	BOSTON PROPERTIES INC	24,257.000	1,382,406.430	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	12,823.000	1,249,216.660	
	CROWN CASTLE INC	59,438.000	5,619,268.520	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	42,218.000	5,252,763.560	
	EQUINIX INC	13,394.000	10,105,237.240	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,598.000	1,738,977.240	
	EQUITY RESIDENTIAL	52,518.000	3,189,943.320	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,774.000	2,172,760.200	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	30,987.000	3,788,160.750	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,642,766.370	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,831.000	977,003.170	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	86,248.000	1,564,538.720	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,484,034.090	
	INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,849,465.830	
	IRON MOUNTAIN INC	39,185.000	2,383,623.550	
	KIMCO REALTY	94,921.000	1,651,625.400	
	MID AMERICA	17,377.000	2,328,865.540	
	PROLOGIS INC	128,697.000	14,465,542.800	
	PUBLIC STORAGE	21,773.000	6,004,557.940	
	REALTY INCOME CORP	93,882.000	4,783,287.900	
	REGENCY CENTERS CORP	20,773.000	1,245,756.810	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	14,329.000	2,888,726.400	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	46,844.000	5,074,610.520	
	SUN COMMUNITIES INC	18,505.000	2,015,194.500	
	UDR INC	41,516.000	1,528,203.960	
	VENTAS INC	52,346.000	2,256,636.060	
	VICI PROPERTIES INC	140,502.000	4,125,138.720	
	WELLTOWER INC	70,141.000	6,018,799.210	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,135,954.750	
	WP CAREY INC	26,416.000	1,437,558.720	
アメリカ・ドル　小計		1,792,498.000	123,773,543.520 (18,474,439,105)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	61,971.000	377,527.330	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,229,853.450	
イギリス・ポンド　小計		227,052.000	1,607,380.780 (295,436,587)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	404,700.800	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	266,267.040	
カナダ・ドル　小計		23,146.000	670,967.840 (73,712,527)	

	ユーロ	COVIVIO	5,066.000	207,706.000	
		GECINA SA	4,647.000	450,759.000	
		KLEPIERRE	25,279.000	578,636.310	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,477.000	855,854.640	
		WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	478,266.040	
	ユーロ　小計		73,615.000	2,571,221.990 (407,615,822)	
	香港・ドル	LINK REIT	349,516.000	13,176,753.200	
	香港・ドル　小計		349,516.000	13,176,753.200 (251,412,451)	
投資証券　合計			2,465,827	19,502,616,492 (19,502,616,492)	
合計				21,138,058,982 (21,138,058,982)	

（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　605銘柄	71.80	－	－	－	74.74
	投資証券　35銘柄	－	－	－	1.68	
イギリス・ポンド	株式　81銘柄	4.30	－	－	－	4.40
	投資証券　2銘柄	－	－	－	0.03	
イスラエル・シュケル	株式　8銘柄	0.10	－	－	－	0.10
オーストラリア・ドル	株式　52銘柄	1.95	－	－	－	2.09
	投資信託受益証券　7銘柄	－	－	0.11	－	
カナダ・ドル	株式　86銘柄	3.30	－	－	－	3.37
	新株予約権証券　1銘柄	－	0.00	－	－	
	投資証券　2銘柄	－	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式　16銘柄	0.32	－	－	－	0.37
	投資信託受益証券　4銘柄	－	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式　45銘柄	2.83	－	－	－	2.87
スウェーデン・クローナ	株式　43銘柄	0.89	－	－	－	0.90
デンマーク・クローネ	株式　16銘柄	0.95	－	－	－	0.96
ニュージーランド・ドル	株式　6銘柄	0.05	－	－	－	0.05
ノルウェー・クローネ	株式　12銘柄	0.21	－	－	－	0.21
ユーロ	株式　222銘柄	9.09	－	－	－	9.28

	投資証券	5銘柄	－	－	－	0.04	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.61	－	－	－	0.64
	投資証券	1銘柄	－	－	－	0.02	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	862,677,611
コール・ローン	1,055,684,898
国債証券	231,971,873,068
派生商品評価勘定	2,550,768
未収入金	456,272,230
未収利息	1,705,305,016
前払費用	218,186,673
流動資産合計	236,272,550,264
資産合計	236,272,550,264
負債の部	
流動負債	
未払金	1,335,416,489
未払解約金	30,868,000
流動負債合計	1,366,284,489
負債合計	1,366,284,489
純資産の部	
元本等	
元本	106,718,442,771
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	128,187,823,004
元本等合計	234,906,265,775
純資産合計	234,906,265,775
負債純資産合計	236,272,550,264

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月12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	86,195,830,752円
同期中追加設定元本額	57,587,053,655円
同期中一部解約元本額	37,064,441,636円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,618,987,452円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,189,821円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	14,819,705円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	35,263,715円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	30,954,306円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	43,562,653円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	28,839,202円
たわらノーロード　先進国債券	19,119,902,959円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	349,844,203円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,950,228,327円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	69,724,646円
たわらノーロード　バランス（標準型）	375,581,733円
たわらノーロード　バランス（積極型）	83,541,875円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	16,221,972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）	1,029,609,162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）	1,823,236,502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）	894,166,041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）	556,219,596円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,837,405円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	13,698,401円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	196,806,190円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	16,286,173円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	25,087,942円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,723,294,703円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	1,211,633,433円

Ｏｎｅグローバルバランス	42,073,444円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	746,657,608円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,391,956,199円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,787,293,445円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	419,650,956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	805,623,667円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	23,760,138円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	895,628,565円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	35,608,551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）	255,538,529円
クルーズコントロール	775,467,474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＞	761,517,566円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	686,043,575円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	178,900,668円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	430,701,083円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	8,674,925円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	74,969,719円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,005,958,089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）	115,471,176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）	118,245,564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）	86,898,161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）	72,130,514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）	113,916,037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）	275,671,790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）	536,780,747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）	102,591,493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）	552,232,376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）	4,788,748,336円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	1,383,713,875円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,513,622,495円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,275,874,366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）	179,244,485円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	44,994,828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）	192,806,099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）	342,211,914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）	204,417,062円

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,792,449円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,546,917円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,669,175円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,855円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,459,547円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,408,927円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,375,785,094円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,303,904,101円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,415,318,444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）	51,492,198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）	108,248,783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）	1,208,330,880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）	184,191,371円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	156,482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）	233,028,996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）	234,791,398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）	351,603,037円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,008,790円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	51,874,906円
コア資産形成ファンド	31,020,227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＞	3,337,771,900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＞	11,863,775,530円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	6,130,196,583円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	4,906,972,546円
計	106,718,442,771円
２．　受益権の総数	106,718,442,771口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△6,319,070,637
合計	△6,319,070,637

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月22日から2023年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	537,000,000	－	539,550,768	2,550,768
アメリカ・ドル	287,929,000	－	289,142,443	1,213,443
イギリス・ポンド	46,577,000	－	46,842,498	265,498
ユーロ	202,494,000	－	203,565,827	1,071,827
合計	537,000,000	－	539,550,768	2,550,768

（注）時価の算定方法

為替予約取引

１．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
２．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
３．　換算において円未満の端数は切捨てております。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2012円 (22,012円)

附属明細表
第１　有価証券明細表
（１）株式
該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2023年10月12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	1,561,929.680	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,224,033.190	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,487,984.350	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,284,289.060	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,394,064.050	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,635,312.480	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,144,695.280	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,379,349.990	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,219,792.200	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,224,212.500	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,713,574.190	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,625,156.240	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,665,521.100	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,671,977.320	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,047,828.120	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,566,874.220	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,387,216.410	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,611,399.220	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,103,351.180	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,786,750.010	

		US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,383,164.050	
		US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,549,957.020	
		US T N/B 0.625 08/15/30	8,240,000.000	6,341,581.270	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,314,542.950	
		US T N/B 0.625 12/31/27	5,320,000.000	4,509,115.590	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,721,973.410	
		US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,184,867.160	
		US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,419,218.710	
		US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,068,539.460	
		US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,418,455.080	
		US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,483,985.930	
		US T N/B 0.875 06/30/26	4,810,000.000	4,338,018.750	
		US T N/B 0.875 09/30/26	4,010,000.000	3,587,070.310	
		US T N/B 0.875 11/15/30	9,480,000.000	7,389,585.930	
		US T N/B 1.0 07/31/28	4,770,000.000	4,032,420.090	
		US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,386,793.150	
		US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,636,381.220	
		US T N/B 1.125 02/15/31	9,690,000.000	7,656,614.050	
		US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,818,544.520	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	978,484.370	
		US T N/B 1.125 02/29/28	4,090,000.000	3,527,065.800	
		US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	1,893,761.710	
		US T N/B 1.125 08/15/40	4,460,000.000	2,533,837.500	
		US T N/B 1.125 08/31/28	5,230,000.000	4,438,247.450	
		US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,032,756.620	
		US T N/B 1.25 03/31/28	5,010,000.000	4,332,671.480	
		US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,399,347.660	
		US T N/B 1.25 05/15/50	4,880,000.000	2,301,987.490	
		US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,562,017.160	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,184,295.890	
		US T N/B 1.25 08/15/31	10,660,000.000	8,349,778.110	
		US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,240,781.250	
		US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,227,062.500	
		US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,491,958.770	
		US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	713,642.570	
		US T N/B 1.375 08/15/50	5,170,000.000	2,522,697.440	
		US T N/B 1.375 08/31/26	2,100,000.000	1,909,605.470	
		US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,027,417.940	
		US T N/B 1.375 11/15/31	9,190,000.000	7,217,380.820	
		US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,556,815.610	
		US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	3,914,851.560	
		US T N/B 1.5 01/31/27	5,740,000.000	5,179,453.110	
		US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,330,586.890	
		US T N/B 1.5 02/15/30	4,130,000.000	3,431,933.180	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,030,000.000	6,421,465.620	
		US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,651,568.010	
		US T N/B 1.5 11/30/24	8,000,000.000	7,666,250.000	
		US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,292,578.100	
		US T N/B 1.625 02/15/26	6,090,000.000	5,653,708.600	

		US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,770,334.730	
		US T N/B 1.625 05/15/31	9,540,000.000	7,757,957.730	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,367,701.570	
		US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,418,007.800	
		US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,197,336.310	
		US T N/B 1.625 11/15/50	5,980,000.000	3,130,857.020	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,646,958.600	
		US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	3,896,806.630	
		US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,811,406.240	
		US T N/B 1.75 08/15/41	5,110,000.000	3,186,763.640	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,850,000.000	2,428,845.680	
		US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,907,562.690	
		US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,924,468.340	
		US T N/B 1.875 02/15/32	8,280,000.000	6,737,203.140	
		US T N/B 1.875 02/15/41	5,200,000.000	3,359,281.200	
		US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,240,864.020	
		US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,292,996.870	
		US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,480,468.750	
		US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,669,624.980	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,848,671.880	
		US T N/B 1.875 11/15/51	4,670,000.000	2,603,342.570	
		US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,954,774.220	
		US T N/B 2.0 02/15/50	4,420,000.000	2,579,570.670	
		US T N/B 2.0 08/15/25	3,550,000.000	3,360,782.230	
		US T N/B 2.0 08/15/51	6,110,000.000	3,527,092.900	
		US T N/B 2.0 11/15/26	3,830,000.000	3,529,285.170	
		US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	2,761,503.870	
		US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,769,781.250	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,250,000.000	2,101,508.780	
		US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,717,560.940	
		US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,495,023.450	
		US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	2,638,789.080	
		US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,102,386.720	
		US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,036,332.770	
		US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,882,250.000	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,070,000.000	1,311,417.770	
		US T N/B 2.25 08/15/49	3,840,000.000	2,388,749.960	
		US T N/B 2.25 11/15/24	3,080,000.000	2,980,020.300	
		US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,847,600.010	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	2,980,170.710	
		US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,893,359.360	
		US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,497,104.680	
		US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,566,874.990	
		US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,939,538.280	
		US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,092,039.450	
		US T N/B 2.375 05/15/29	4,470,000.000	3,979,696.870	
		US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	3,527,125.000	
		US T N/B 2.375 11/15/49	3,790,000.000	2,424,785.750	
		US T N/B 2.5 01/31/25	500,000.000	482,705.080	

		US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,567,732.030	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,187,351.940	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,159,676.540	
		US T N/B 2.5 03/31/27	4,000,000.000	3,722,656.230	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,230,000.000	1,492,619.140	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,339,017.950	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,377,187.500	
		US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,725,252.320	
		US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,890,078.140	
		US T N/B 2.625 05/31/27	5,410,000.000	5,039,119.110	
		US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,759,042.580	
		US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,856,328.140	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,205,352.330	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,895,496.080	
		US T N/B 2.75 04/30/27	3,500,000.000	3,278,789.080	
		US T N/B 2.75 05/15/25	2,200,000.000	2,120,164.060	
		US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	2,994,105.470	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,000,370.300	
		US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,565,283.580	
		US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	6,797,831.210	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	908,251.550	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,554,815.220	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,754,941.410	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,135,515.290	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,565,947.250	
		US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,932,382.820	
		US T N/B 2.875 04/30/29	3,800,000.000	3,475,664.070	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,860,000.000	4,511,446.870	
		US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,074,880.870	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,696,970.510	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,600,000.000	2,566,265.610	
		US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,197,167.180	
		US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,514,804.680	
		US T N/B 2.875 06/15/25	2,420,000.000	2,333,787.500	
		US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,117,585.930	
		US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,651,767.580	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,281,452.350	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	774,878.890	
		US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,219,431.240	
		US T N/B 3.0 02/15/47	2,660,000.000	1,951,775.000	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	1,935,949.220	
		US T N/B 3.0 02/15/49	4,610,000.000	3,367,100.740	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	827,043.740	
		US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	957,371.480	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,187,346.090	
		US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,088,624.980	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	2,781,300.000	
		US T N/B 3.0 08/15/52	3,740,000.000	2,726,547.650	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,684,785.140	

		US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,182,924.200	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,162,748.430	
		US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	635,862.500	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,066,298.430	
		US T N/B 3.125 02/15/43	1,740,000.000	1,346,936.700	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,116,862.080	
		US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,927,796.670	
		US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,596,155.850	
		US T N/B 3.125 08/31/27	3,940,000.000	3,725,146.860	
		US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,871,040.220	
		US T N/B 3.125 11/15/28	5,480,000.000	5,110,742.190	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	802,492.960	
		US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	2,995,809.350	
		US T N/B 3.25 06/30/27	3,500,000.000	3,330,742.170	
		US T N/B 3.25 06/30/29	3,300,000.000	3,071,449.220	
		US T N/B 3.375 05/15/33	2,500,000.000	2,269,726.550	
		US T N/B 3.375 05/15/44	1,930,000.000	1,539,551.940	
		US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,364,686.720	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,950,000.000	3,095,812.500	
		US T N/B 3.5 01/31/28	3,380,000.000	3,231,596.870	
		US T N/B 3.5 01/31/30	2,500,000.000	2,346,337.900	
		US T N/B 3.5 02/15/33	8,800,000.000	8,083,624.990	
		US T N/B 3.5 02/15/39	1,000,000.000	863,789.050	
		US T N/B 3.5 04/30/30	2,000,000.000	1,874,375.000	
		US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,916,562.500	
		US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,355,319.530	
		US T N/B 3.625 02/15/53	3,700,000.000	3,059,437.500	
		US T N/B 3.625 03/31/28	3,800,000.000	3,648,593.750	
		US T N/B 3.625 03/31/30	2,000,000.000	1,888,984.380	
		US T N/B 3.625 05/15/26	3,500,000.000	3,398,417.960	
		US T N/B 3.625 05/15/53	3,510,000.000	2,904,525.000	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,226,933.200	
		US T N/B 3.75 04/15/26	2,000,000.000	1,948,437.500	
		US T N/B 3.75 08/15/41	1,220,000.000	1,054,442.180	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,239,574.210	
		US T N/B 3.875 01/15/26	4,300,000.000	4,205,433.580	
		US T N/B 3.875 02/15/43	2,500,000.000	2,173,046.870	
		US T N/B 3.875 03/31/25	1,050,000.000	1,030,661.130	
		US T N/B 3.875 05/15/43	800,000.000	694,937.500	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,144,875.000	
		US T N/B 3.875 09/30/29	2,950,000.000	2,834,074.190	
		US T N/B 3.875 11/30/27	3,000,000.000	2,912,695.320	
		US T N/B 3.875 11/30/29	4,800,000.000	4,606,218.760	
		US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,465,773.420	
		US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,685,593.730	
		US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,921,250.000	
		US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,896,640.640	
		US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,121,624.990	
		US T N/B 4.0 10/31/29	2,500,000.000	2,417,285.150	

		US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	2,765,709.350	
		US T N/B 4.0 11/15/52	4,860,000.000	4,307,744.520	
		US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,059,949.200	
		US T N/B 4.125 01/31/25	1,800,000.000	1,774,792.960	
		US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,619,953.120	
		US T N/B 4.125 09/30/27	3,920,000.000	3,844,050.000	
		US T N/B 4.125 10/31/27	4,940,000.000	4,842,357.820	
		US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,337,265.620	
		US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	895,078.120	
		US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,943,593.750	
		US T N/B 4.25 11/15/40	1,300,000.000	1,208,619.120	
		US T N/B 4.25 12/31/24	5,500,000.000	5,432,109.370	
		US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	581,507.790	
		US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,147,042.180	
		US T N/B 4.375 05/15/41	930,000.000	875,725.770	
		US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	3,956,250.000	
		US T N/B 4.375 10/31/24	2,070,000.000	2,049,080.290	
		US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	951,562.500	
		US T N/B 4.5 02/15/36	500,000.000	498,867.190	
		US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	586,781.240	
		US T N/B 4.5 07/15/26	2,600,000.000	2,579,890.610	
		US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	948,283.970	
		US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,537,228.500	
		US T N/B 4.5 11/30/24	4,200,000.000	4,161,527.320	
		US T N/B 4.625 02/15/40	1,690,000.000	1,654,120.500	
		US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,610,006.640	
		US T N/B 4.625 09/15/26	1,000,000.000	996,171.880	
		US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,214,961.320	
		US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	576,571.290	
		US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,387,652.330	
		US T N/B 5.375 02/15/31	1,160,000.000	1,218,634.380	
		US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,456,624.990	
		US T N/B 6.125 11/15/27	1,200,000.000	1,265,625.000	
		US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	829,266.780	
アメリカ・ドル　小計			873,830,000.000 (130,427,865,800)	752,233,146.120 (112,278,319,391)	
イギリス・ポンド		UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,590,656.200	
		UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,124,997.000	
		UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,000,000.000	1,889,432.800	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,652,144.810	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,130,000.000	1,891,120.500	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,520,000.000	1,169,647.600	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,980,000.000	1,627,903.160	

		UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	525,837.490	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	994,626.830	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,650,000.000	1,074,678.000	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,190,000.000	450,177.000	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,370,000.000	644,875.440	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,800,000.000	1,305,486.000	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,330,000.000	1,098,433.160	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,670,000.000	2,064,470.700	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,610,000.000	994,725.620	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	254,856.000	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	985,325.000	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,930,000.000	896,878.720	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,800,000.000	1,052,424.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,200,000.000	1,112,100.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	539,100.000	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,110,000.000	540,856.820	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	910,913.460	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	634,637.790	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	366,445.000	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	830,000.000	466,081.520	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	574,177.400	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,345,236.980	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,057,830.000	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	763,125.000	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,840,000.000	1,479,598.090	
		UK TREASURY 3.25 01/31/33	1,800,000.000	1,653,049.440	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,550,000.000	1,285,526.600	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,480,000.000	1,171,085.200	
		UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,463,325.000	
		UK TREASURY 3.75 01/29/38	700,000.000	635,399.100	

		UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	817,710.000	
		UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,400,000.000	1,173,961.600	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	793,980.000	
		UK TREASURY 4.0 10/22/63	520,000.000	457,106.000	
		UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,190,000.000	2,165,264.380	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,300,000.000	1,272,156.600	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,820,000.000	1,822,908.360	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,012,105.790	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,010,000.000	1,007,323.500	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,015,257.080	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,183,884.280	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	937,300.140	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,512,000.000	1,393,754.040	
		UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,050,000.000	1,055,752.210	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,209,600.000	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,265,000.000	1,229,271.340	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,495,000.000	1,545,940.630	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,380,000.000	1,400,562.000	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,485,000.000	1,490,436.870	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	734,189.200	
	イギリス・ポンド　小計		79,214,000.000 (14,559,533,200)	63,005,647.450 (11,580,438,001)	
	イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	320,000.000	307,109.440	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,330,000.000	1,220,142.000	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,788,423.840	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,350,920.000	
		ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	700,000.000	552,221.600	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,720,000.000	1,194,423.040	
		ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,911,156.000	

	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	660,000.000	451,652.520	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,560,000.000	1,454,965.200	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,159,770.520	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,910,000.000	1,637,907.130	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,110,000.000	1,229,419.350	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,293,873.440	
イスラエル・シュケル　小計		19,640,000.000 (740,622,436)	17,551,984.080 (661,883,564)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,690,000.000	1,619,469.650	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,350,470.500	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,815,000.000	1,643,365.000	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,170,000.000	1,680,272.090	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,336,107.390	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,658,147.660	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,810,000.000	1,481,520.220	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,420,000.000	757,358.420	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,250,000.000	1,806,613.950	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,230,000.000	1,139,936.010	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,060,000.000	1,859,956.950	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,020,000.000	778,206.860	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	547,762.290	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,364,393.090	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	900,000.000	846,670.040	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,295,495.950	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,040,000.000	776,243.320	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	2,070,000.000	1,831,251.540	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,700,000.000	1,679,077.140	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,400,000.000	1,342,273.480	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	690,650.170	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	800,000.000	732,437.070	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	761,609.820	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,800,000.000	1,695,645.080	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,611,605.910	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,672,732.350	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,390,000.000	1,426,548.100	
オーストラリア・ドル　小計		40,215,000.000 (3,851,792,700)	35,385,820.050 (3,389,253,844)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	10,000,000.000	9,923,676.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	19,943,283.790	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,474,811.890	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	49,500,000.000	49,470,217.830	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,743,032.520	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	39,500,000.000	39,376,416.350	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	25,000,000.000	24,808,028.750	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	26,000,000.000	25,894,137.360	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,066,973.920	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,387,762.890	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	14,300,000.000	14,151,342.630	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	17,500,000.000	17,432,926.520	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	22,600,000.000	22,584,187.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	33,600,000.000	33,828,325.440	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	23,000,000.000	22,930,562.080	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	20,034,872.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,125,202.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,020,421.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	26,000,000.000	26,155,890.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,093,066.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,072,722.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	33,300,000.000	33,500,479.320	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	23,500,000.000	23,789,080.550	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	12,100,000.000	12,263,403.240	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	22,100,000.000	22,445,383.220	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	24,500,000.000	25,010,663.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	16,500,000.000	16,889,409.900	

		CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	41,000,000.000	41,677,971.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	7,500,000.000	7,622,368.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,243,313.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,906,639.340	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,135,338.100	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	19,320,000.000	20,148,847.320	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	14,100,000.000	14,928,855.810	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	16,450,000.000	17,909,184.090	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,230,759.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	6,600,000.000	7,415,061.060	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	12,500,000.000	14,219,856.250	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	5,800,000.000	6,608,088.480	
オフショア・人民元　小計			770,020,000.000 (15,746,600,992)	780,462,563.550 (15,960,147,240)	
カナダ・ドル		CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,273,053.750	
		CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,133,269.090	
		CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,037,500.290	
		CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	777,615.510	
		CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	491,107.760	
		CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,151,641.480	
		CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	665,955.680	
		CANADA 1.25 03/01/27	910,000.000	822,047.130	
		CANADA 1.25 06/01/30	2,350,000.000	1,973,869.370	
		CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,046,689.530	
		CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,574,704.340	
		CANADA 1.5 06/01/31	2,770,000.000	2,318,807.240	
		CANADA 1.5 12/01/31	2,420,000.000	2,006,306.180	
		CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,418,602.150	
		CANADA 2.0 06/01/28	830,000.000	758,000.590	
		CANADA 2.0 06/01/32	1,540,000.000	1,319,522.380	
		CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,434,496.630	
		CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,267,258.910	
		CANADA 2.25 06/01/29	530,000.000	483,800.320	
		CANADA 2.25 12/01/29	100,000.000	90,682.830	
		CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,351,304.030	
		CANADA 2.75 06/01/33	1,180,000.000	1,069,195.820	
		CANADA 2.75 09/01/27	1,250,000.000	1,182,023.900	

	CANADA 2.75 12/01/48	1,160,000.000	974,745.140	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	313,279.170	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,400,000.000	1,348,308.020	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,605,033.260	
	CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	841,387.230	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,000,000.000	960,383.500	
	CANADA 3.25 12/01/33	700,000.000	661,434.310	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,130,000.000	1,097,902.030	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	390,964.650	
	CANADA 3.5 12/01/45	680,000.000	649,844.470	
	CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,141,508.170	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	579,848.680	
	CANADA 5.0 06/01/37	530,000.000	589,243.670	
	CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	803,839.820	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	697,171.120	
カナダ・ドル　小計		47,800,000.000 (5,251,308,000)	42,302,348.150 (4,647,335,968)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	480,000.000	450,196.800	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	477,105.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	740,000.000	654,160.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	840,000.000	658,560.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	402,112.050	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	590,000.000	568,462.850	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	890,000.000	791,655.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	763,885.850	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	169,332.750	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	330,310.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	360,000.000	337,680.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	618,380.400	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	577,197.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	196,560.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	602,640.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	125,600.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	580,000.000	580,832.300	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	802,160.000	
シンガポール・ドル　小計		9,805,000.000 (1,073,941,650)	9,106,830.000 (997,471,090)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,020,033.600	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,080,166.200	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,910,000.000	3,460,277.290	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	8,210,000.000	7,713,306.390	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,500,000.000	2,258,085.290	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	3,864,478.310	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,838,445.640	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,470,000.000	3,696,729.800	
スウェーデン・クローナ　小計		36,370,000.000 (497,905,300)	33,931,522.520 (464,522,543)	

デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,200,000.000	2,121,551.510	
	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,035,398.580	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,260,000.000	2,000,828.280	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,417,355.750	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,290,000.000	4,602,904.110	
	DENMARK 1.75 11/15/25	6,740,000.000	6,560,608.160	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,400,000.000	1,310,239.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,330,000.000	9,793,071.200	
デンマーク・クローネ　小計		38,150,000.000 (811,069,000)	34,841,956.590 (740,739,997)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	517,272.340	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	511,943.540	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	670,648.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	228,355.380	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	440,000.000	338,423.900	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	720,000.000	690,543.680	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	594,985.700	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	540,000.000	325,140.890	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	550,000.000	489,655.080	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	386,906.580	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	117,517.260	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	778,024.320	
ニュージーランド・ドル　小計		6,950,000.000 (624,249,000)	5,649,416.670 (507,430,605)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,182,513.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,510,000.000	3,841,888.600	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,335,165.980	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,600,000.000	3,351,024.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,093,352.970	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,597,515.200	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,898,811.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,830,000.000	2,471,447.490	
	NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,698,415.200	
ノルウェー・クローネ　小計		29,320,000.000 (403,150,000)	26,470,133.940 (363,964,342)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,627,679.560	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,470,000.000	4,191,313.380	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,370,000.000	3,316,178.870	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,920,000.000	2,896,848.640	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	2,091,036.250	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,290,000.000	3,069,375.890	

	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,142,304.160	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,113,930.800	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,734,638.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,540,074.000	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,477,906.150	
	POLAND 5.75 04/25/29	2,190,000.000	2,222,201.760	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,100,000.000	2,284,100.490	
ポーランド・ズロチ　小計		37,430,000.000 (1,311,360,050)	33,707,587.950 (1,180,945,344)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	998,790.130	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	643,331.190	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,347,471.200	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,990,530.080	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,389,704.960	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,770,259.890	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,625,867.080	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	750,000.000	754,583.320	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	697,114.640	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,003,476.100	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,736,655.130	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,669,887.280	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	920,000.000	925,603.530	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,750,000.000	2,766,891.870	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,562,611.800	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	678,156.580	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	600,000.000	603,966.660	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,066,088.410	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,600,000.000	1,581,075.550	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,236,021.720	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,037,333.570	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	996,106.630	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,600,000.000	1,650,125.430	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	306,974.430	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,788,435.020	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,089,629.350	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,696,532.160	
マレーシア・リンギット　小計		37,550,000.000 (1,187,214,595)	37,613,223.710 (1,189,213,533)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,080,000.000	21,786,745.200	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	11,680,000.000	10,867,656.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	16,790,000.000	14,501,690.900	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	12,290,000.000	10,302,092.500	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,615,268.750	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	18,702,000.000	18,500,196.230	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	36,282,000.000	32,747,159.740	

		MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	28,146,000.000	25,912,896.360	
		MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	31,148,000.000	27,771,245.320	
		MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	21,007,000.000	17,443,372.520	
		MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	9,335,000.000	8,112,208.350	
		MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	21,061,000.000	17,790,016.090	
		MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	23,159,000.000	21,935,741.620	
		MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	16,642,000.000	15,057,348.760	
	メキシコ・ペソ　小計		276,807,000.000 (2,317,566,608)	248,343,638.340 (2,079,257,112)	
	ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,180,000.000	966,875.480	
		AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,310,000.000	1,036,152.360	
		AUSTRIA 0.0 04/20/25	890,000.000	846,308.120	
		AUSTRIA 0.0 10/20/28	570,000.000	488,019.750	
		AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	247,860.000	
		AUSTRIA 0.25 10/20/36	680,000.000	449,752.000	
		AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,220,000.000	1,064,154.760	
		AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	979,204.080	
		AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	158,719.420	
		AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,135,000.000	1,028,606.230	
		AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	305,713.220	
		AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,111,433.820	
		AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	117,915.870	
		AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,100,000.000	910,112.500	
		AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	904,610.880	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	498,219.710	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	99,066.000	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	200,000.000	196,358.000	
		AUSTRIA 1.85 05/23/49	490,000.000	351,250.620	
		AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	446,743.720	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	253,474.840	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	611,736.880	
		AUSTRIA 2.9 02/20/33	400,000.000	385,889.600	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	640,000.000	601,777.280	
		AUSTRIA 3.15 10/20/53	200,000.000	183,864.400	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	324,585.500	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,072,918.960	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,210,000.000	1,256,159.080	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	682,632.160	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	1,080,000.000	957,429.440	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	804,552.320	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	1,300,000.000	1,064,635.000	
		BELGIUM 0.35 06/22/32	1,250,000.000	973,500.000	

		BELGIUM 0.4 06/22/40	950,000.000	561,600.100	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	450,000.000	436,428.000	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	320,130.450	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	1,880,000.000	1,803,423.840	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,260,000.000	1,163,169.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	846,564.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	1,500,000.000	1,332,964.500	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,460,000.000	1,381,346.150	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,570,000.000	1,335,393.020	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	677,923.830	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	1,490,000.000	855,403.040	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	380,000.000	292,272.440	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	606,878.920	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	880,000.000	569,712.000	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	488,981.780	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	298,170.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	277,017.000	
		BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	284,630.080	
		BELGIUM 3.0 06/22/33	500,000.000	484,567.660	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	980,000.000	942,082.680	
		BELGIUM 3.3 06/22/54	270,000.000	241,536.600	
		BELGIUM 3.45 06/22/43	100,000.000	95,144.200	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	635,497.550	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	930,000.000	979,541.100	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,363,748.960	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,103,784.180	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,420,000.000	1,618,616.820	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,570,000.000	1,732,595.480	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,510,000.000	3,268,125.900	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,516,219.230	
		BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,610,000.000	1,464,610.560	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,860,000.000	1,711,107.000	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,650,000.000	2,496,220.500	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,273,333.500	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,280,000.000	2,161,052.400	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	700,000.000	663,733.000	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,535,598.150	
		BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,800,000.000	1,763,478.000	
		BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	1,350,000.000	1,331,154.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,520,000.000	1,290,875.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,340,000.000	1,935,460.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,900,000.000	2,333,398.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,360,000.000	985,075.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,880,000.000	1,319,854.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,430,000.000	2,037,603.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	746,923.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,690,000.000	2,194,851.700	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	653,396.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,477,848.770	

		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,010,000.000	477,083.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,040,000.000	905,862.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,454,063.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,560,000.000	2,244,026.880	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,953,198.400	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,930,000.000	2,589,856.300	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,570,000.000	2,295,729.600	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,830,593.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,860,000.000	3,649,398.400	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,970,000.000	1,798,196.300	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,310,000.000	2,128,526.400	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	2,590,000.000	2,393,421.590	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	2,490,000.000	2,142,353.670	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,660,000.000	1,286,383.800	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,330,460.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,820,000.000	2,013,804.300	
		DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,330,000.000	2,155,529.600	
		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,850,000.000	1,443,980.500	
		DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,000,000.000	1,938,260.000	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,850,000.000	1,790,948.000	
		DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	300,000.000	294,867.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,370,000.000	2,216,945.400	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,170,000.000	2,021,984.300	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,030,000.000	1,075,567.200	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,930,000.000	2,168,154.280	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	1,981,996.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,288,206.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,020,000.000	2,387,741.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,510,000.000	1,870,527.600	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,820,000.000	3,342,348.600	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,462,077.900	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,180,000.000	1,422,560.800	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	650,000.000	733,856.500	
		FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	169,126.650	
		FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	185,666.940	
		FINLAND 0.125 04/15/52	560,000.000	230,300.000	
		FINLAND 0.125 09/15/31	600,000.000	471,225.000	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	169,927.990	

		FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	431,705.400	
		FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	219,254.680	
		FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	362,186.530	
		FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	573,257.100	
		FINLAND 0.5 09/15/29	800,000.000	687,983.110	
		FINLAND 0.75 04/15/31	400,000.000	335,554.000	
		FINLAND 0.875 09/15/25	910,000.000	870,512.370	
		FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	386,726.400	
		FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	197,998.500	
		FINLAND 1.375 04/15/47	380,000.000	254,153.820	
		FINLAND 1.5 09/15/32	550,000.000	475,908.400	
		FINLAND 2.625 07/04/42	430,000.000	378,546.070	
		FINLAND 2.75 04/15/38	270,000.000	245,376.650	
		FINLAND 2.75 07/04/28	390,000.000	384,275.580	
		FINLAND 4.0 07/04/25	510,000.000	515,617.650	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	2,190,000.000	2,091,547.450	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,530,000.000	3,280,845.540	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,100,000.000	2,800,115.300	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,590,000.000	2,735,939.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,590,000.000	2,984,413.670	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,780,000.000	3,843,029.180	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	4,770,000.000	3,701,872.980	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,220,000.000	2,952,730.020	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,430,000.000	3,279,793.440	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,060,000.000	4,732,081.640	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	4,190,000.000	3,645,115.640	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,250,000.000	765,797.500	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	262,267.510	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,390,000.000	757,183.040	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,880,000.000	3,520,215.360	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,110,000.000	4,613,164.920	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,270,000.000	1,578,625.200	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,550,000.000	1,200,700.650	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,500,000.000	4,018,734.000	
		FRANCE OAT 03/25/25	3,970,000.000	3,783,064.610	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,760,000.000	3,498,319.040	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,619,101.610	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	2,897,199.540	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,780,000.000	2,924,208.000	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/38	500,000.000	367,450.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,480,000.000	4,887,780.240	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,470,000.000	2,181,085.850	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	593,464.410	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,570,000.000	2,017,727.560	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	980,000.000	961,279.540	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,250,000.000	1,632,246.750	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,550,000.000	2,303,823.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,350,000.000	4,202,398.740	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,200,000.000	999,352.800	

		FRANCE OAT 2.5 09/24/26	2,720,000.000	2,671,902.240	
		FRANCE OAT 2.75 02/25/29	1,500,000.000	1,476,231.000	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,390,000.000	2,363,351.500	
		FRANCE OAT 3.0 05/25/33	1,500,000.000	1,466,067.600	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,340,000.000	2,186,243.280	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,885,381.500	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,592,080.810	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,526,602.280	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,040,000.000	2,141,395.330	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,740,000.000	3,040,641.020	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,623,730.280	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,100,000.000	3,474,839.600	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,610,000.000	3,116,914.200	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,286,696.090	
		IRISH 0.0 10/18/31	870,000.000	681,183.900	
		IRISH 0.2 05/15/27	620,000.000	560,972.900	
		IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	286,561.310	
		IRISH 0.35 10/18/32	600,000.000	470,168.750	
		IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	267,579.190	
		IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	155,437.250	
		IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	645,619.450	
		IRISH 1.0 05/15/26	900,000.000	854,161.920	
		IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	657,944.230	
		IRISH 1.3 05/15/33	90,000.000	76,131.490	
		IRISH 1.35 03/18/31	460,000.000	408,190.660	
		IRISH 1.5 05/15/50	670,000.000	432,418.000	
		IRISH 1.7 05/15/37	680,000.000	550,830.680	
		IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	645,687.840	
		IRISH 2.4 05/15/30	760,000.000	729,993.480	
		IRISH 3.0 10/18/43	310,000.000	291,299.560	
		IRISH 5.4 03/13/25	820,000.000	843,891.920	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,839,412.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,650,000.000	1,482,855.000	
		ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,300,622.400	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,241,000.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,600,000.000	1,529,556.480	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,000,000.000	825,800.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,492,856.400	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	935,000.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,920,000.000	1,446,969.600	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,554,219.000	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,652,539.340	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,580,000.000	991,766.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,180,000.000	884,882.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,087,155.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,500,912.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,303,689.200	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,001,275.000	
		ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,295,685.600	

		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,630,000.000	1,505,897.890	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,551,332.300	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	916,608.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,880,000.000	1,812,054.850	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	480,000.000	467,815.200	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	610,000.000	336,781.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,760,000.000	1,695,101.370	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,850,000.000	2,692,110.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,990,000.000	1,610,381.630	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,140,000.000	1,792,710.100	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,120,000.000	591,752.000	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	734,160.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,199,080.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,440,000.000	1,329,357.240	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,599,277.200	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,589,442.200	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,790,000.000	1,709,387.350	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	189,864.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	294,423.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,499,688.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,032,512.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,430,000.000	1,192,840.220	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	729,905.000	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,510,151.050	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,613,205.290	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,142,350.000	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,820,000.000	1,730,638.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,490,000.000	1,036,593.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	437,500.000	
		ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,118,160.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,829,214.360	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,199,280.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,710,000.000	1,609,965.000	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,260,000.000	1,003,464.000	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	499,560.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	907,599.360	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,620,000.000	1,425,003.800	
		ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,350,000.000	1,316,790.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	940,706.900	
		ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,300,568.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,085,968.920	
		ITALY BTPS 3.7 06/15/30	300,000.000	290,070.000	
		ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,498,348.420	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,430,000.000	1,195,319.120	
		ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,665,660.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,170,000.000	2,015,279.000	
		ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,086,688.000	
		ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,100,000.000	1,072,170.000	
		ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,100,000.000	1,089,220.000	

		ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,200,000.000	1,115,760.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,141,017.000	
		ITALY BTPS 4.5 10/01/53	370,000.000	337,440.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,680,000.000	2,764,395.600	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,660,000.000	1,608,226.260	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	568,276.240	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,460,000.000	2,524,698.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,790,000.000	1,807,184.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,250,000.000	1,258,250.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,792,856.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,592,276.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,748,336.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,210,000.000	2,419,950.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	383,390.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/26	2,460,000.000	2,296,783.920	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,073,567.540	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,310,000.000	1,125,878.190	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	350,030.600	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,200,000.000	511,059.350	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	575,631.000	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,400,000.000	1,116,891.820	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,360,000.000	1,170,048.800	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,210,000.000	799,672.060	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,420,000.000	1,326,635.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,100,000.000	890,959.820	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,071,761.120	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,580,000.000	1,430,768.660	
		NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	513,721.810	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	910,000.000	872,080.300	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/33	450,000.000	428,625.000	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,510,000.000	1,410,694.850	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,420,000.000	1,524,375.090	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,620,000.000	1,763,856.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	940,000.000	1,034,658.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	2,050,000.000	1,958,467.500	
		SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,519,050.000	
		SPAIN 0.0 01/31/27	1,610,000.000	1,442,479.500	
		SPAIN 0.0 01/31/28	2,180,000.000	1,890,605.000	
		SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	822,759.870	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,880,000.000	1,418,460.000	
		SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,488,726.000	
		SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,288,393.840	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,294,614.090	
		SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,454,673.500	

		SPAIN 0.8 07/30/27	2,050,000.000	1,863,962.500	
		SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,460,895.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	1,100,000.000	729,294.710	
		SPAIN 1.0 07/30/42	840,000.000	491,148.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,790,000.000	855,317.490	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,810,000.000	1,152,141.810	
		SPAIN 1.25 10/31/30	2,150,000.000	1,841,475.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,930,000.000	1,817,004.290	
		SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	1,992,394.180	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,670,000.000	1,527,465.500	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,900,000.000	1,713,236.970	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,727,318.760	
		SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	172,526.000	
		SPAIN 1.5 04/30/27	1,910,000.000	1,792,917.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,584,695.780	
		SPAIN 1.85 07/30/35	1,690,000.000	1,362,915.190	
		SPAIN 1.9 10/31/52	970,000.000	577,187.630	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,730,000.000	1,671,381.810	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,604,604.120	
		SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,768,029.720	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,070,000.000	922,340.000	
		SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,568,847.260	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,710,000.000	1,289,598.210	
		SPAIN 2.75 10/31/24	1,290,000.000	1,277,039.370	
		SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,772,370.000	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,430,000.000	1,140,802.520	
		SPAIN 3.15 04/30/33	1,670,000.000	1,588,427.180	
		SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	656,034.420	
		SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	907,552.800	
		SPAIN 3.55 10/31/33	1,520,000.000	1,485,040.000	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,600,000.000	1,628,028.800	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,934,764.680	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,630,000.000	1,724,760.050	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,710,000.000	1,838,250.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	2,060,000.000	2,222,019.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,354,359.990	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,815,000.000	2,097,728.520	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,930,000.000	2,057,071.200	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,660,000.000	1,865,982.760	
	ユーロ　小計		537,677,000.000 (85,237,934,810)	478,968,967.980 (75,930,950,494)	
国債証券　合計			264,042,114,140.500 (264,042,114,141)	231,971,873,068 (231,971,873,068)	
合計				231,971,873,068 (231,971,873,068)	

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

２．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	国債証券	250銘柄	47.80	48.40
イギリス・ポンド	国債証券	57銘柄	4.93	4.99
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	0.28	0.29
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	1.44	1.46
オフショア・人民元	国債証券	39銘柄	6.79	6.88
カナダ・ドル	国債証券	38銘柄	1.98	2.00
シンガポール・ドル	国債証券	18銘柄	0.42	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.20	0.20
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.32	0.32
ニュージーランド・ドル	国債証券	12銘柄	0.22	0.22
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.15	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.50	0.51
マレーシア・リンギット	国債証券	27銘柄	0.51	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.89	0.90
ユーロ	国債証券	350銘柄	32.32	32.73

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,905,510,372
コール・ローン	476,850,074
株式	75,532,418,299
投資信託受益証券	592,937,406
投資証券	82,171,584
派生商品評価勘定	79,835,920
未収入金	81,586,774
未収配当金	128,128,504
差入委託証拠金	816,268,359
流動資産合計	80,695,707,292
資産合計	80,695,707,292
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,439,627
未払解約金	1,120,000
流動負債合計	21,559,627
負債合計	21,559,627
純資産の部	
元本等	
元本	52,985,968,815
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	27,688,178,850
元本等合計	80,674,147,665
純資産合計	80,674,147,665
負債純資産合計	80,695,707,292

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月12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	66,356,355,641円
同期中追加設定元本額	42,809,922,285円
同期中一部解約元本額	56,180,309,111円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	9,586,920,128円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ専用＞	3,775,455,553円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,706,266円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	11,454,061円

ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	28,871,968円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	38,787,188円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	33,682,256円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,529,670円
たわらノーロード　新興国株式	12,370,601,649円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	2,076,954,861円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	4,283,684,474円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	33,805,472円
たわらノーロード　バランス（標準型）	137,925,681円
たわらノーロード　バランス（積極型）	243,979,709円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	93,091円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	5,456,273円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	97,709,592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）	167,259,894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）	257,960,721円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	71,286円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	9,839,566円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,628,215円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	8,301,811円
たわらノーロード　全世界株式	680,923,315円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	1,022,650,618円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	369,862,643円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	401,972,605円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	591,013,966円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	1,113,780,649円
投資のソムリエ	7,507,871,705円
クルーズコントロール	376,823,244円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	646,984,281円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	453,252,164円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	590,570,420円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,123,826,578円
ワールドアセットバランス（基本コース）	535,942,539円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,000,625,399円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	36,271,415円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	18,579,336円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,335,105円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	94,616,989円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,325,882,279円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	321,914,153円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	33,630,306円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	19,804,233円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	12,076,006円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,844,457円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	24,867,481円
エマージング株式パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	10,107,837円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	214,019,319円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	1,713,583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）	169,504,048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）	85,022,757円
計	52,985,968,815円
２．　受益権の総数	52,985,968,815口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）

株式	△1,779,762,033
投資信託受益証券	42,949,224
投資証券	3,058,538
合計	△1,733,754,271

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年4月19日から2023年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	603,915,000	－	603,915,000	－
台湾・ドル	603,915,000	－	603,915,000	－
買建	978,560,810	－	979,474,050	913,240
アメリカ・ドル	978,560,810	－	979,474,050	913,240
合計	1,582,475,810	－	1,583,389,050	913,240

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	4,398,222,031	－	4,456,705,084	58,483,053
合計	4,398,222,031	－	4,456,705,084	58,483,053

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5226円 (15,226円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,977	8.320	149,568.640	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	5,142	128.310	659,770.020	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,496	74.330	482,847.680	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	219,522	1.282	281,427.200	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	1.390	123,710.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	51,568	2.027	104,528.330	
	EFG HOLDING S.A.E. -GDR	62,824	0.750	47,118.000	
	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	16.390	444,824.600	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,410	9.370	331,791.700	
	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	15,835	37.190	588,903.650	
	JOYY INC-ADR	3,434	41.600	142,854.400	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,056	27.560	139,343.360	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	16.790	167,900.000	
	NIO INC ADR	107,141	8.970	961,054.770	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	60,221	6.790	408,900.590	
	AUTOHOME INC ADR	4,983	29.640	147,696.120	
	MINISO GROUP HOLDING LTD ADR	7,141	26.000	185,666.000	
	WEIBO CORP ADR	6,261	13.210	82,707.810	
	KANZHUN LTD ADR	16,449	16.550	272,230.950	
	KE HOLDINGS INC ADR	50,953	16.900	861,105.700	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	4,555	66.670	303,681.850	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	1.080	65,273.040	
	PDD HOLDINGS INC ADR	46,485	110.070	5,116,603.950	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	32,148	55.000	1,768,140.000	
	IQIYI INC ADR	33,439	4.990	166,860.610	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	32,772	24.450	801,275.400	
アメリカ・ドル　小計		307,367,072		14,805,784.370 (2,209,911,375)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	115,717	10.900	1,261,315.300	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	234,419	5.570	1,305,713.830	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	269,581	19.360	5,219,088.160	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	220,337	8.630	1,901,508.310	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	343,388	13.440	4,615,134.720	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	511,120	7.780	3,976,513.600	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	312,686	5.820	1,819,832.520	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	145,839	17.700	2,581,350.300	
	MULTIPLY GROUP	316,386	3.850	1,218,086.100	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	188,416	3.840	723,517.440	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	257,162	3.570	918,068.340	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		2,915,051		25,540,128.620 (1,039,483,235)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	236,722	2,345.050	555,124,926.100	

BHARAT PETROLEUM CORP LTD	59,189	342.550	20,275,191.950	
ASIAN PAINTS LTD	29,567	3,163.900	93,547,031.300	
BANK OF BARODA	75,579	207.200	15,659,968.800	
EICHER MOTORS LTD	11,150	3,486.600	38,875,590.000	
GRASIM INDUSTRIES LTD	21,160	1,980.100	41,898,916.000	
HDFC BANK LTD	217,346	1,539.600	334,625,901.600	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	72,195	1,556.300	112,357,078.500	
SHREE CEMENT LTD	655	26,501.350	17,358,384.250	
ICICI BANK LTD	403,157	953.100	384,248,936.700	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	42,590	254.100	10,822,119.000	
STATE BANK OF INDIA LTD	138,452	588.350	81,458,234.200	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	19,563	698.450	13,663,777.350	
TATA STEEL LTD	562,663	124.950	70,304,741.850	
TATA MOTORS LTD	129,917	634.000	82,367,378.000	
JSW STEEL LTD	49,199	777.250	38,239,922.750	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	44,090	888.400	39,169,556.000	
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,047	6,884.500	14,092,571.500	
TATA POWER CO LTD	114,167	253.950	28,992,709.650	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,830	4,554.950	40,220,208.500	
NESTLE INDIA LTD	2,625	23,202.050	60,905,381.250	
GAIL INDIA LTD	178,074	123.550	22,001,042.700	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	84,714	1,771.400	150,062,379.600	
VEDANTA LTD	60,107	227.650	13,683,358.550	
SUPREME INDUSTRIES LTD	4,911	4,124.800	20,256,892.800	
AXIS BANK LTD	177,043	1,019.100	180,424,521.300	
TITAN COMPANY LTD	27,778	3,280.500	91,125,729.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	242,048	183.250	44,355,296.000	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	8,846	2,060.750	18,229,394.500	
BHARAT ELECTRONICS LTD	291,728	137.750	40,185,532.000	
LUPIN LTD	15,323	1,159.850	17,772,381.550	
MPHASIS LTD	6,694	2,464.100	16,494,685.400	
BAJAJ FINANCE LTD	21,182	8,101.950	171,615,504.900	
INFOSYS LTD	258,346	1,494.400	386,072,262.400	
WIPRO LTD	106,724	421.150	44,946,812.600	
TATA ELXSI LTD	2,473	7,315.100	18,090,242.300	
MRF LTD	132	107,738.150	14,221,435.800	
INDIAN OIL CORP LTD	225,534	89.700	20,230,399.800	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	63,740	2,556.400	162,944,936.000	
TRENT LTD	14,518	2,101.300	30,506,673.400	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	7,535	5,092.850	38,374,624.750	
CUMMINS INDIA LTD	9,929	1,751.600	17,391,636.400	

HCL TECHNOLOGIES LTD	73,844	1,245.600	91,980,086.400	
DABUR INDIA LTD	48,446	543.750	26,342,512.500	
HERO MOTOCORP LTD	8,789	3,100.850	27,253,370.650	
SRF LTD	11,697	2,250.000	26,318,250.000	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	5,506	2,586.300	14,240,167.800	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	8,154	5,567.600	45,398,210.400	
BHARTI AIRTEL LTD	173,415	955.600	165,715,374.000	
UNITED SPIRITS LTD	22,673	1,050.350	23,814,585.550	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	74,378	1,128.750	83,954,167.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,597	3,750.550	35,994,028.350	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,621	10,412.100	110,586,914.100	
AUROBINDO PHARMA LTD	19,570	899.900	17,611,043.000	
HAVELLS INDIA LTD	19,728	1,390.950	27,440,661.600	
TVS MOTOR COMPANY LTD	19,289	1,550.250	29,902,772.250	
INDRAPRASTHA GAS LTD	27,995	460.400	12,888,898.000	
JINDAL STEEL & POWER LTD	27,284	692.550	18,895,534.200	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	175,495	95.400	16,742,223.000	
SHRIRAM FINANCE LTD	22,842	1,898.600	43,367,821.200	
PETRONET LNG LTD	64,449	224.750	14,484,912.750	
CIPLA LTD/INDIA	39,463	1,171.950	46,248,662.850	
LARSEN & TOUBRO LTD	53,604	3,088.700	165,566,674.800	
ULTRATECH CEMENT LTD	8,909	8,343.000	74,327,787.000	
ASHOK LEYLAND LTD	107,265	176.350	18,916,182.750	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	71,417	3,609.900	257,808,228.300	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,830	2,488.600	34,417,338.000	
NTPC LTD	335,864	238.700	80,170,736.800	
YES BANK LTD	977,054	17.050	16,658,770.700	
AMBUJA CEMENTS LTD	43,914	445.100	19,546,121.400	
BHARAT FORGE LTD	18,955	1,114.350	21,122,504.250	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,664	483.900	48,227,409.600	
ITC LTD	233,139	448.250	104,504,556.750	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,991	2,487.650	29,829,411.150	
UNITED PHOSPHORUS LTD	31,641	627.750	19,862,637.750	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,896	1,885.500	13,002,408.000	
SIEMENS INDIA LTD	7,072	3,558.500	25,165,712.000	
INFO EDGE INDIA LTD	5,574	4,265.300	23,774,782.200	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	45,301	404.450	18,321,989.450	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,439	985.850	31,979,988.150	
TECH MAHINDRA LTD	41,245	1,231.600	50,797,342.000	
INDIAN HOTELS CO LTD	67,997	414.850	28,208,555.450	
MARICO LTD	37,579	536.100	20,146,101.900	

POWER FINANCE CORP LTD	105,240	250.000	26,310,000.000	
PAGE INDUSTRIES LTD	445	39,513.850	17,583,663.250	
ABB LTD/INDIA	3,825	4,185.400	16,009,155.000	
DLF LTD	49,742	565.300	28,119,152.600	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	356,271	198.500	70,719,793.500	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,610	814.850	34,720,758.500	
REC LTD	93,873	291.600	27,373,366.800	
BAJAJ FINSERV LTD	28,844	1,636.550	47,204,648.200	
BAJAJ AUTO LTD	5,519	5,064.400	27,950,423.600	
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	531.500	16,086,379.000	
ADANI POWER LTD	57,006	349.800	19,940,698.800	
MUTHOOT FINANCE LTD	7,836	1,236.150	9,686,471.400	
COAL INDIA LTD	124,565	301.850	37,599,945.250	
PI INDUSTRIES LTD	6,390	3,488.300	22,290,237.000	
VARUN BEVERAGES LTD	36,637	917.650	33,619,943.050	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,498	2,924.300	24,850,701.400	
LTIMINDTREE LTD	7,277	5,244.450	38,163,862.650	
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,366	962.450	24,413,506.700	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	78,537	621.500	48,810,745.500	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	715.750	11,308,134.250	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	13,342	1,961.600	26,171,667.200	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	6,402	2,747.200	17,587,574.400	
BANDHAN BANK LTD	52,105	248.750	12,961,118.750	
GODREJ PROPERTIES LTD	9,790	1,727.450	16,911,735.500	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	33,265	1,259.700	41,903,920.500	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	22,115	800.700	17,707,480.500	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	18,362	704.600	12,937,865.200	
ZOMATO LTD	349,029	109.000	38,044,161.000	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	62,663	573.950	35,965,428.850	
SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	30,418	559.650	17,023,433.700	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	234,098	225.100	52,695,459.800	
ASTRAL POLYTECHNIK LTD	8,729	1,934.700	16,887,996.300	
BERGER PAINTS INDIA LTD	18,984	560.850	10,647,176.400	
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,233	3,852.050	50,974,177.650	
IDFC BANK LTD	258,025	91.550	23,622,188.750	

	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	18,938	1,313.550	24,876,009.900	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	25,192	524.900	13,223,280.800	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	10,946	2,533.150	27,727,859.900	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	33,449	1,309.350	43,796,448.150	
インド・ルピー　小計		9,466,458		6,679,156,271.200 (12,089,272,851)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	547,000	1,815.000	992,805,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,178,385	1,225.000	2,668,521,625.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	105,601	26,275.000	2,774,666,275.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	6,750.000	2,457,000,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	3,610.000	2,135,676,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,549,400	6,050.000	9,373,870,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,777,600	3,780.000	14,279,328,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	637,600	5,450.000	3,474,920,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	191,900	10,675.000	2,048,532,500.000	
	BANK MANDIRI	2,901,300	6,050.000	17,552,865,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,315,000	5,250.000	27,903,750,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,192,000	5,175.000	6,168,600,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,785,000	1,750.000	3,123,750,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	234,932	6,525.000	1,532,931,300.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,326,500	8,925.000	38,614,012,500.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	161,400	5,550.000	895,770,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,250,300	2,760.000	3,450,828,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	10,700.000	2,076,870,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,207,700	2,880.000	3,478,176,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,319,900	955.000	1,260,504,500.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	66,987,200	79.000	5,291,988,800.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,045,082	2,540.000	2,654,508,280.000	
インドネシア・ルピア　小計		97,863,500		154,209,873,780.000 (1,464,993,801)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	5,532	44.940	248,608.080	

SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	47.700	276,660.000	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	11.100	251,970.000	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	22.420	133,174.800	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	72.510	217,530.000	
HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	15,000	16.480	247,200.000	
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	7,140	16.210	115,739.400	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	9.230	110,760.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	44.440	230,199.200	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	14.810	180,682.000	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	14.210	248,675.000	
UNISPLENDOUR CORP LTD	7,040	23.690	166,777.600	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	9.080	95,340.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.930	227,863.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	69.280	83,136.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	17.440	282,528.000	
HUAGONG TECH CO LTD	2,200	33.710	74,162.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	141.310	296,751.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	29.090	343,262.000	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	14.660	130,474.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	28.700	232,470.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	13,600	17.880	243,168.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	18.250	253,675.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	14.040	335,556.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	7.230	227,745.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	3.830	236,694.000	
GEM CO LTD	29,100	6.100	177,510.000	

THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	79.050	205,530.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	24.410	168,429.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	5.100	296,310.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	13.390	226,291.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	5,900	87.550	516,545.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	7.840	122,249.120	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	25.520	150,670.080	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	16.270	94,561.240	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	9.130	270,248.000	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	23.630	315,696.800	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	18.920	124,872.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	29.330	149,583.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	45.190	420,267.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	23.130	240,552.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	34.990	34,990.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	35.650	855,600.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	8,550	57.800	494,190.000	
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	5,700	24.070	137,199.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	9.730	175,140.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	10.470	188,460.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	55.410	559,641.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	11.830	132,496.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	9.990	247,752.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.500	95,950.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	10.470	58,632.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	18.650	262,965.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	29.170	350,040.000	

HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	22.510	175,578.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	11.800	608,290.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	48.020	288,120.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	81.430	182,321.770	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	37.900	434,713.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	12.410	157,607.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.940	144,598.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	18.830	748,097.070	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	32.310	348,948.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	3,584	28.120	100,782.080	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	500	29.800	14,900.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	16.300	112,470.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	27,500	6.180	169,950.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	47.860	234,514.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	11.890	181,917.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	41.970	260,214.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	30.470	152,350.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	21.710	345,189.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	21.130	207,074.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	6,300	210.130	1,323,819.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	66.860	320,928.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	6.740	100,763.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	22.470	307,277.250	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	11.090	96,926.600	

BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	9,682	11.310	109,503.420	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	37.450	340,795.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	152.610	549,396.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.250	228,000.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	7.890	112,827.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	31,154	31.820	991,320.280	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	17.300	517,270.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.600	154,000.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	7.270	518,351.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	10.600	210,940.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	22.770	434,907.000	
IFLYTEK CO LTD	8,500	55.480	471,580.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.230	208,282.000	
GOERTEK INC	25,100	18.310	459,581.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.660	141,858.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	26.590	935,968.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	8,200	13.310	109,142.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	50,320	4.110	206,815.200	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.720	161,876.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	4.110	154,536.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	14.330	580,193.040	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.510	147,777.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	26.340	323,982.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	53.400	561,768.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	15.230	1,186,691.140	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,800	126.080	983,424.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,700	153.700	2,874,190.000	

WANDA FILM HOLDING CO LTD	21,700	12.520	271,684.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	7,000	6.850	47,950.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.950	861,495.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	11.950	548,505.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	35.070	424,347.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.210	389,583.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	10.980	1,067,256.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	24,480	17.700	433,296.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	62,500	4.310	269,375.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	12.770	703,627.000	
ZTE CORP	16,500	33.920	559,680.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.700	190,950.000	
WEICHAI POWER CO LTD	16,900	12.680	214,292.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	35.760	150,192.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	14.580	564,246.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	9.200	194,120.000	
BYD CO LTD	8,400	238.590	2,004,156.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	5.750	173,650.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	6.100	208,010.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	26.500	255,990.000	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	43.290	225,973.800	
LB GROUP CO LTD	11,000	18.790	206,690.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	14,900	10.960	163,304.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	14.930	125,412.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	36.130	75,873.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	27.410	263,136.000	

SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	19.960	233,532.000	
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	6,400	28.200	180,480.000	
RISEN ENERGY CO LTD	1,100	18.690	20,559.000	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU CO LTD	15,200	12.710	193,192.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	18.040	144,320.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	17.380	220,726.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,200	244.290	537,438.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	6.940	208,894.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	19.780	253,184.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.990	239,058.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	1,400	5.870	8,218.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	13.300	73,815.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	269.610	458,337.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.140	111,384.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	47.160	311,256.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	45.820	27,492.000	
NINESTAR CORP	1,100	26.810	29,491.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	6.330	241,806.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	9.900	251,658.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	60.000	96,000.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	17.100	288,990.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	24.280	259,796.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	156.150	284,193.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	85.280	153,504.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	6.610	99,811.000	
SF HOLDING CO LTD	24,400	40.910	998,204.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.780	136,408.000	

BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	41.880	167,520.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	76.830	192,075.000	
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	4,700	32.810	154,207.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	36,790	6.120	225,154.800	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	10.000	389,000.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	5.670	413,910.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	48.170	110,791.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	24.590	641,799.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	27.650	178,646.650	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	12.750	116,025.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	14.270	353,896.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	59.580	184,698.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	9.890	222,525.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46	24.430	1,123.780	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	6.960	270,048.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	22.570	83,509.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	6,760	15.720	106,267.200	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	15.990	244,295.220	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	87.020	191,444.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	36.780	162,199.800	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	58.510	216,487.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	52.990	143,073.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	37.020	114,762.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	93.330	195,993.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	36.840	335,833.440	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	13.100	124,450.000	

ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,100	109.730	340,163.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	11.820	121,746.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	65.200	6,520.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	32.340	223,146.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	67.990	308,674.600	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	130.540	391,620.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	52.190	67,847.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	27.650	132,720.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	28.500	88,350.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	29.940	95,808.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.850	99,695.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	58.590	140,616.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	13.480	287,124.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	10.850	143,220.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	100	73.860	7,386.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	62.200	118,180.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	36,700	7.990	293,233.000	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	24.200	285,560.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	42,300	19.170	810,891.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	271.700	1,575,860.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	60,800	3.830	232,864.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	8.120	125,860.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	91.030	145,648.000	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	4,050	57.770	233,968.500	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	13.090	111,265.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	26.360	107,021.600	
SG MICRO CORP	95	84.910	8,066.450	

CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	19,640	194.770	3,825,282.800	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	105.000	316,680.000	
WUXI APPTEC CO LTD	10,572	88.150	931,921.800	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	28.550	294,065.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	3.820	315,150.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	47.030	343,319.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	125.000	320,000.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	25,300	14.070	355,971.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	32.220	239,233.500	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	960	74.600	71,616.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	244.300	268,730.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	63.200	69,520.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,655	34.130	193,005.150	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	46.660	117,583.200	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	152.100	456,300.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	53.740	290,196.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	5.020	268,068.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	41.410	111,807.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	26.110	214,102.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	101.490	510,494.700	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	3,325	40.960	136,192.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	15.380	196,864.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.490	284,607.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	3.530	249,571.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	21.350	228,445.000	

CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.190	203,112.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	72.450	159,390.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	39.470	114,463.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	142,600	4.930	703,018.000	
GONGNIU GROUP CO LTD	1,900	102.750	195,225.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	63.900	204,480.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	177.500	142,000.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	129.690	199,203.840	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	4.920	578,592.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.960	230,160.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	38.600	88,780.000	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	900	100.070	90,063.000	
HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	596	265.700	158,357.200	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	4,000	60.300	241,200.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	6.470	281,445.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	5,070	25.780	130,704.600	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	75.680	105,952.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	34.490	210,389.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	29.880	47,808.000	
SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD	7,600	22.690	172,444.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	33.750	202,500.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	45.600	130,416.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	24.530	283,861.160	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.960	247,776.000	

BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	7,077	48.550	343,588.350	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	62.020	179,858.000	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	5,320	21.480	114,273.600	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	121.500	315,900.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,900	36.660	289,614.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	39.400	181,240.000	
PIOTECH INC	592	241.990	143,258.080	
ASR MICROELECTRONICS CO LTD	4,000	61.440	245,760.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	9.520	382,704.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	127.000	355,600.000	
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP INC	5,600	51.390	287,784.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	36.100	146,566.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,100	390.150	429,165.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	144.840	463,488.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	380.850	931,939.950	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	19.460	369,740.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	840	296.550	249,102.000	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	40.110	344,946.000	
HUNAN CHANGYUAN LICO CO LTD	22,400	8.430	188,832.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.240	415,744.000	
PETROCHINA CO LTD	77,700	7.660	595,182.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	4.720	1,442,904.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	3.650	1,507,815.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	3.770	738,920.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	117,600	5.800	682,080.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	36.270	500,526.000	

CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	30.860	1,046,154.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	98,300	32.450	3,189,835.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	49,600	47.690	2,365,424.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	90,300	16.160	1,459,248.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	116,900	7.020	820,638.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	134,500	3.710	498,995.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.820	629,850.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	5,800	1,778.500	10,315,300.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	162,200	5.750	932,650.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	21.510	1,284,147.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	25,600	28.570	731,392.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.010	191,883.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	120,200	22.630	2,720,126.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.200	594,720.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	3.040	700,112.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	171,800	5.240	900,232.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	9.810	544,455.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.610	396,627.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	27.050	800,680.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	66,400	4.570	303,448.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	124,800	4.920	614,016.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	133,600	6.030	805,608.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	24.920	578,144.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	13.860	572,418.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.650	451,350.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	25.580	299,286.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	12.420	691,794.000	
CRRC CORP LTD	141,700	5.610	794,937.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	33,352	45.050	1,502,507.600	

CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	21.810	379,494.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	23,900	15.600	372,840.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	6.310	540,136.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	35.820	236,412.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	23.080	593,156.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	15.210	733,122.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	3.660	370,758.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	6.340	356,308.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	3,300	28.750	94,875.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	7.660	202,224.000	
GEMDALE CORP	39,700	6.380	253,286.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	33,300	16.010	533,133.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	16,000	87.490	1,399,840.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.780	376,186.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	12.130	1,255,455.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	7.250	399,475.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	11.980	457,636.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	22.330	931,428.960	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	6.180	184,164.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	100.230	982,254.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	10.000	309,000.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.710	380,475.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	86.390	380,116.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.390	84,750.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	37,200	6.210	231,012.000	
AIR CHINA LTD	44,800	7.740	346,752.000	
TBEA CO LTD	24,180	14.630	353,753.400	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	7.640	332,340.000	

METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.440	193,328.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	46,700	5.290	247,043.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	27.490	582,788.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	36.920	383,968.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	31.040	214,176.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	18.560	276,544.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	4.060	139,258.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	18.400	106,720.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	9.090	229,068.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	9.160	302,280.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	14.920	353,604.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	17.900	204,060.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	36.460	339,078.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	7.910	453,243.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,324	10.590	119,921.160	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	48,070	9.470	455,222.900	
CMOC GROUP LIMITED	53,400	5.840	311,856.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	8,500	10.790	91,715.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	6.370	215,306.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	52.790	475,110.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	24.970	502,396.400	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	23.250	181,350.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	10.680	295,836.000	
PEOPLE.CN CO LTD	7,000	37.070	259,490.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	84,500	3.130	264,485.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.440	386,352.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	21,000	19.900	417,900.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	6.150	263,835.000	

CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	4.290	341,055.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	15.400	231,292.600	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	4.980	288,840.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	18.610	143,297.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	32.430	332,861.520	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	17.300	281,125.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	16.920	55,836.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	28,700	5.980	171,626.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.690	158,710.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	38.080	388,416.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.590	181,251.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	7.030	179,968.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	38.150	175,490.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	8.110	136,248.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	800	23.720	18,976.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	14,200	8.660	122,972.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	8.130	181,705.500	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.030	158,782.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	5.830	114,268.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	12.860	299,638.000	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	270.770	676,925.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	6.500	221,650.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,380	239.900	1,530,562.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	11.590	146,034.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.260	355,568.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	7.240	181,000.000	

CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	1,250	38.950	48,687.500	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	15.120	306,936.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	3.100	90,520.000	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	14,400	25.840	372,096.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	8.650	275,935.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	14.550	183,330.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	12.850	335,385.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	34.450	144,690.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.550	268,460.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	8.300	393,918.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	16.840	213,868.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	16.840	98,177.200	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	10.730	209,235.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.110	142,898.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	10.290	230,496.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	31.620	537,540.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	10,654	44.760	476,873.040	
JCET GROUP CO LTD	10,900	30.890	336,701.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	25.020	170,136.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	84.220	210,550.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	34.460	182,638.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	31.830	333,896.700	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	95.150	161,755.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	13.640	276,155.440	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	2.320	144,768.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	13.780	181,896.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,924	59.170	232,183.080	

ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	8.060	157,976.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	14.150	277,340.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	12.050	237,385.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	14.440	226,708.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	2,210	67.900	150,059.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	34.170	167,433.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	18.900	105,840.000	
SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	122.850	257,985.000	
BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	15.970	236,356.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	45.710	191,982.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,500	49.650	74,475.000	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	94.500	85,050.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	1,540	74.710	115,053.400	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	33.720	87,672.000	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	1,000	191.790	191,790.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	86.500	138,400.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	134.200	187,880.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	53.550	380,205.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	30.000	333,000.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	100,600	4.750	477,850.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	22.240	257,984.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	13,300	6.000	79,800.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	126.740	126,740.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	840	232.400	195,216.000	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	1,600	140.800	225,280.000	
3PEAK INC	1,200	178.230	213,876.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	160	45.610	7,297.600	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	29,968	26.960	807,937.280	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	13.560	172,212.000	

CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	153.490	276,282.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	4.190	307,127.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	26.330	268,566.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	40,151	18.270	733,558.770	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	18,519	40.360	747,426.840	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	4,400	58.150	255,860.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	32.240	225,680.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	7.970	105,204.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	72.540	507,780.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	1,000	13.900	13,900.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	14.390	585,673.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	7.260	762,300.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	50.940	173,196.000	
SERES GROUP CO LTD	5,000	65.710	328,550.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	72.750	385,575.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,800	64.260	179,928.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.060	587,392.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	12,200	10.920	133,224.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	20.230	230,622.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	45.500	63,700.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	17.710	35,420.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	4,100	14.600	59,860.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	950	39.360	37,392.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	10.810	328,624.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	6.700	283,410.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	89.500	286,400.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	1,500	17.300	25,950.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,012	27.900	111,934.800	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,004	34.520	138,218.080	

	G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	500	361.800	180,900.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	50.600	148,764.000	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	17.390	196,680.900	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	8.760	431,868.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	52.100	343,860.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	16.240	259,840.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	35.530	159,885.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	103,500	2.620	271,170.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	12.390	132,573.000	
オフショア・人民元　小計		12,849,958		177,706,596.610 (3,634,028,818)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	360,578	15.850	5,715,161.300	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	257,559	5.320	1,370,213.880	
	OOREDOO QSC	60,920	9.987	608,408.040	
	QATAR FUEL QSC	40,844	16.140	659,222.160	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	28,983	17.230	499,377.090	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	67,025	9.510	637,407.750	
	INDUSTRIES QATAR QSC	122,724	13.330	1,635,910.920	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	133,476	18.200	2,429,263.200	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	190,107	3.623	688,757.660	
	MASRAF AL RAYAN	427,066	2.120	905,379.920	
	BARWA REAL ESTATE CO	137,134	2.520	345,577.680	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	382,470	1.734	663,202.980	
	DUKHAN BANK	131,518	3.750	493,192.500	
カタール・リアル　小計		2,340,404		16,651,075.080 (683,027,100)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	638,691	0.706	450,915.840	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	152,316	0.457	69,608.410	
	GULF BANK KSCP	146,991	0.254	37,335.710	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	595,211	0.840	499,977.240	

	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	116,021	0.519	60,214.890	
	MABANEE CO KPSC	44,922	0.830	37,285.260	
	BOUBYAN BANK KSCP	96,698	0.595	57,535.310	
クウェート・ディナール　小計		1,790,850		1,212,872.660 (584,543,978)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	39,057	14,390.000	562,030,230.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	30,200.000	605,479,800.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	37,131	27,250.000	1,011,819,750.000	
コロンビア・ペソ　小計		96,237		2,179,329,780.000 (76,801,761)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	20,519	39.000	800,241.000	
	JARIR MARKETING CO	45,430	14.920	677,815.600	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	5,690	114.800	653,212.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	29,955	44.000	1,318,020.000	
	SAUDI BRITISH BANK	76,852	33.100	2,543,801.200	
	AL RAJHI BANK	152,394	65.000	9,905,610.000	
	ARAB NATIONAL BANK	53,396	22.800	1,217,428.800	
	BANK ALBILAD	39,341	39.200	1,542,167.200	
	BANK AL-JAZIRA	29,917	15.740	470,893.580	
	BANQUE SAUDI FRANSI	47,493	35.500	1,686,001.500	
	RIYAD BANK	112,991	26.650	3,011,210.150	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,345	14.760	610,252.200	
	SAUDI TELECOM CO	155,677	35.350	5,503,181.950	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	17,734	132.800	2,355,075.200	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	70,894	79.100	5,607,715.400	
	SAUDI ELECTRICITY CO	67,449	17.920	1,208,686.080	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	23.440	652,733.680	
	SAVOLA GROUP	19,024	35.000	665,840.000	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	19,672	11.980	235,670.560	
	ALMARAI CO JSC	19,978	60.000	1,198,680.000	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,024	163.400	494,121.600	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	25,951	34.800	903,094.800	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	38.100	387,248.400	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	55,402	12.080	669,256.160	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	46,657	14.420	672,793.940	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	29,849	10.300	307,444.700	

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	13.000	468,767.000	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,017	205.200	1,234,688.400	
	ALINMA BANK	75,217	31.900	2,399,422.300	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	99,314	40.200	3,992,422.800	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,033	100.400	706,113.200	
	DALLAH HEALTHCARE CO	2,553	138.200	352,824.600	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	207,037	33.550	6,946,091.350	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	7,189	227.600	1,636,216.400	
	ACWA POWER CO	7,732	199.000	1,538,668.000	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	129.000	513,549.000	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	1,730	314.200	543,566.000	
	NAHDI MEDICAL CO	3,277	136.800	448,293.600	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,500	181.800	636,300.000	
	ELM CO	1,951	744.000	1,451,544.000	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	53.700	356,299.500	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	227,397	32.000	7,276,704.000	
サウジアラビア・リアル　小計		1,921,267		75,799,665.850 (3,021,374,681)	
タイ・バーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	94,700	30.000	2,841,000.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	19.600	5,938,800.000	
	CP AXTRA PCL NVDR	159,300	30.500	4,858,650.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	88,300	31.250	2,759,375.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	128.500	5,833,900.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,317,300	1.700	3,939,410.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	650,500	8.000	5,204,000.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	18,500	123.000	2,275,500.000	
	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	91,700	222.000	20,357,400.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	387,020	12.300	4,760,346.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	240,500	86.000	20,683,000.000	

	PTT PCL	777,500	33.500	26,046,250.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	46.750	3,763,375.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	656,100	7.900	5,183,190.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	63,750	302.000	19,252,500.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	339,500	68.750	23,340,625.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	147,900	64.000	9,465,600.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	844,500	27.500	23,223,750.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	48,200	263.000	12,676,600.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	237,810	30.500	7,253,205.000	
	THAI OIL PCL NVDR	88,500	50.000	4,425,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	448,900	59.750	26,821,775.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	643,100	7.450	4,791,095.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	113,645	169.000	19,206,005.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	135,122	25.750	3,479,391.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	169,708	34.250	5,812,499.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	142,900	48.750	6,966,375.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	8.150	5,133,685.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	51,900	26.000	1,349,400.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	238,100	44.500	10,595,450.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	90,600	24.400	2,210,640.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	379,000	3.700	1,402,300.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	157,833	39.000	6,155,487.000	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	97,800	35.250	3,447,450.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	183,000	18.900	3,458,700.000	
	SCB X PCL NVDR	67,700	103.500	7,006,950.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	896,328	7.100	6,363,928.800	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	58,700	36.500	2,142,550.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	42,500	43.000	1,827,500.000	
タイ・バーツ　小計		12,597,916		343,073,057.300 (1,413,460,996)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	672.000	3,952,032.000	
	CEZ	12,278	982.500	12,063,135.000	
	MONETA MONEY BANK AS	21,592	83.500	1,802,932.000	
チェコ・コルナ　小計		39,751		17,818,099.000 (115,108,483)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	41.910	221,276,753.280	

	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,910	22,540.000	110,671,400.000	
	BANCO DE CHILE	3,730,618	92.000	343,216,856.000	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,610.000	136,692,220.000	
	EMPRESAS COPEC SA	27,553	6,290.000	173,308,370.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,442	5,566.000	58,120,172.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,173,923	52.100	61,161,388.300	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	101.000	170,029,561.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	10,947	52,940.000	579,534,180.000	
	FALABELLA SA	78,482	1,973.000	154,844,986.000	
	CENCOSUD SA	89,376	1,587.300	141,866,524.800	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-RTS	723	523.260	378,316.980	
	ENEL CHILE SA	2,550,215	54.620	139,292,743.300	
チリ・ペソ　小計		14,725,360		2,290,393,471.660 (367,138,622)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	234,997	33.320	7,830,100.040	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	103,003	41.980	4,324,065.940	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	107,671	44.120	4,750,444.520	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	875.000	4,979,625.000	
	HEKTAS TICARET TAS	78,592	25.060	1,969,515.520	
	KOC HOLDING AS	60,321	152.700	9,211,016.700	
	SASA POLYESTER SANAYI	84,709	45.780	3,877,978.020	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	94,818	52.950	5,020,613.100	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	9,553	296.000	2,827,688.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,287	230.100	10,190,438.700	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	104,797	55.300	5,795,274.100	
	TURKIYE IS BANKASI	262,880	25.340	6,661,379.200	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	77,581	144.400	11,202,696.400	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	245,976	19.300	4,747,336.800	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	82,771	57.700	4,775,886.700	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	36,458	320.600	11,688,434.800	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	78,429	28.060	2,200,717.740	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	3,431	748.800	2,569,132.800	
トルコ・リラ　小計		1,715,965		104,622,344.080 (563,422,710)	

ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	11,459	8,865.000	101,584,035.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	36,818	2,780.000	102,354,040.000	
	OTP BANK NYRT	18,084	13,535.000	244,766,940.000	
ハンガリー・フォリント　小計		66,361		448,705,015.000 (184,165,140)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	514,500	28.650	14,740,425.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	104,690	49.350	5,166,451.500	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	151,438	108.400	16,415,879.200	
	AYALA CORP	17,413	615.500	10,717,701.500	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	79,760	202.000	16,111,520.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	229,760	37.550	8,627,488.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	34,240	220.600	7,553,344.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	113,235	53.450	6,052,410.750	
	BDO UNIBANK INC	189,402	136.000	25,758,672.000	
	PLDT INC	5,690	1,235.000	7,027,150.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	820,375	31.100	25,513,662.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	115.000	8,676,750.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	828.000	16,049,124.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	375.000	9,157,500.000	
フィリピン・ペソ　小計		2,379,756		177,568,078.450 (466,808,721)	
ブラジル・レアル	VALE SA	264,689	67.360	17,829,451.040	
	RAIA DROGASIL SA	104,664	28.030	2,933,731.920	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	40.630	830,883.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	90,900	36.530	3,320,577.000	
	BANCO DO BRASIL SA	67,200	48.970	3,290,784.000	
	ITAUSA SA	405,026	9.150	3,705,987.900	
	GERDAU SA	93,181	22.520	2,098,436.120	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	286,210	38.120	10,910,325.200	
	VIBRA ENERGIA SA	92,700	20.160	1,868,832.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	373,912	35.120	13,131,789.440	
	CCR SA	73,020	12.720	928,814.400	
	WEG SA	130,044	35.170	4,573,647.480	
	BANCO BRADESCO SA PREF	414,702	14.710	6,100,266.420	
	BANCO BRADESCO SA	126,592	12.860	1,627,973.120	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	11.770	567,384.620	
	SUZANO SA	60,975	56.650	3,454,233.750	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	34.290	579,501.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	379,247	27.980	10,611,331.060	

	ENGIE BRASIL SA	15,287	41.530	634,869.110	
	LOCALIZA RENT A CAR	68,689	55.590	3,818,421.510	
	LOJAS RENNER SA	69,220	13.100	906,782.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	53,904	19.780	1,066,221.120	
	COSAN SA	98,200	16.630	1,633,066.000	
	TOTVS SA	44,400	27.480	1,220,112.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	81,900	31.940	2,615,886.000	
	JBS SA	58,500	19.170	1,121,445.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	109,262	12.520	1,367,960.240	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,198	62.170	1,690,899.660	
	ENEVA SA	57,000	11.640	663,480.000	
	HYPERA SA	29,800	35.910	1,070,118.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	450,948	12.030	5,424,904.440	
	MAGAZINE LUIZA SA	239,400	1.910	457,254.000	
	PRIO SA	60,500	47.600	2,879,800.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	33,228	46.460	1,543,772.880	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,100	31.750	1,844,675.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	427,361	4.230	1,807,737.030	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	54,800	9.790	536,492.000	
	AMBEV SA	370,495	13.290	4,923,878.550	
	NATURA &CO HOLDING SA	68,800	14.840	1,020,992.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	104,700	12.170	1,274,199.000	
	TIM SA	60,800	15.220	925,376.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	46,300	24.310	1,125,553.000	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	538	11.000	5,918.000	
	RUMO SA	105,100	23.070	2,424,657.000	
ブラジル・レアル　小計		5,843,048		132,368,419.510 (3,908,654,112)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	447.300	601,171.200	
	BUDIMEX SA	1,092	461.500	503,958.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,918	110.800	1,209,714.400	
	BANK PEKAO SA	14,797	112.150	1,659,483.550	
	ORLEN SA	43,255	60.650	2,623,415.750	
	LPP SA	92	12,630.000	1,161,960.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,760	392.400	1,083,024.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,671	109.700	512,408.700	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	65,055	39.290	2,556,010.950	

	CYFROWY POLSAT SA	15,965	12.440	198,604.600	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	79,636	6.912	550,444.030	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	44,273	42.850	1,897,098.050	
	DINO POLSKA SA	3,987	359.600	1,433,725.200	
	ALLEGRO.EU SA	38,700	28.610	1,107,207.000	
	PEPCO GROUP NV	16,587	19.030	315,650.610	
ポーランド・ズロチ　小計		343,132		17,413,876.040 (610,095,147)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	102,000	3.900	397,800.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	498,800	5.600	2,793,280.000	
	CELCOMDIGI BHD	272,700	4.290	1,169,883.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	57,020	7.260	413,965.200	
	RHB BANK BHD	103,780	5.570	578,054.600	
	GAMUDA BHD	156,100	4.540	708,694.000	
	GENTING BHD	164,900	4.100	676,090.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	14,956	17.460	261,131.760	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	19.400	950,755.200	
	IOI CORP BHD	223,013	3.930	876,441.090	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,500	21.880	951,780.000	
	MALAYAN BANKING BHD	435,975	8.900	3,880,177.500	
	MISC BHD	102,180	7.120	727,521.600	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,200	122.600	760,120.000	
	PPB GROUP BHD	55,660	15.060	838,239.600	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	22.680	519,372.000	
	PETRONAS GAS BHD	61,000	17.020	1,038,220.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.480	595,448.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	4.960	472,688.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	213,550	9.990	2,133,364.500	
	QL RESOURCES BHD	70,350	5.450	383,407.500	
	DIALOG GROUP BHD	292,144	2.150	628,109.600	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,131,750	4.150	4,696,762.500	
	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.290	536,776.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	239,500	2.410	577,195.000	
	MAXIS BHD	164,500	4.000	658,000.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	2.930	650,167.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	217,600	7.230	1,573,248.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	153,100	5.950	910,945.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	267,700	4.770	1,276,929.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	161,500	4.240	684,760.000	
	MR DIY GROUP M BHD	245,100	1.590	389,709.000	
マレーシア・リンギット　小計		6,318,186		33,709,034.650	

				(1,065,775,178)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	262,900	10.910	2,868,239.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	100,200	79.650	7,980,930.000	
	GRUMA SAB DE CV	13,370	285.140	3,812,321.800	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	12,860	155.830	2,003,973.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	44,800	133.600	5,985,280.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	201,900	152.950	30,880,605.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	87,025	35.810	3,116,365.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,495	200.600	3,108,297.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	33.910	4,123,456.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	15,465	397.320	6,144,553.800	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	240,052	78.390	18,817,676.280	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	134,000	36.660	4,912,440.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,800	154.340	6,605,752.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	405,600	61.830	25,078,248.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	29,590	254.050	7,517,339.500	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	14.550	1,513,200.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,457,478	15.180	22,124,516.040	
	BANCO DEL BAJIO SA	55,600	56.760	3,155,856.000	
メキシコ・ペソ　小計		3,344,735		159,749,049.470 (1,337,498,917)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	54,745	2.840	155,475.800	
	ALPHA BANK A.E.	180,331	1.274	229,741.690	
	NATIONAL BANK OF GREECE	45,590	5.384	245,456.560	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,083	13.250	213,099.750	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	185,464	1.482	274,857.640	
	MYTILINEOS HOLDINGS	8,855	34.240	303,195.200	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,506	22.100	121,682.600	
	OPAP SA	12,855	15.280	196,424.400	
	JUMBO SA	9,500	25.320	240,540.000	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	9.470	159,806.250	
ユーロ　小計		538,934		2,140,279.890 (339,298,571)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	72,500.000	124,700,000.000	

HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	103,300.000	302,462,400.000	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,478	257,500.000	638,085,000.000	
DB INSURANCE CO LTD	3,297	89,100.000	293,762,700.000	
COWAY CO LTD	3,735	40,800.000	152,388,000.000	
KT&G CORP	8,264	86,700.000	716,488,800.000	
KAKAO CORP	23,743	42,650.000	1,012,638,950.000	
HANWHA OCEAN CO LTD	4,022	29,600.000	119,051,200.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	23,496	6,110.000	143,560,560.000	
NCSOFT CORPORATION	1,025	227,500.000	233,187,500.000	
LG UPLUS CORP	17,131	10,340.000	177,134,540.000	
DOOSAN ENERBILITY	36,105	15,210.000	549,157,050.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	67,500.000	285,187,500.000	
LG H&H CO LTD	696	421,500.000	293,364,000.000	
LG CHEM LTD	3,825	518,000.000	1,981,350,000.000	
LG CHEM LTD	599	334,500.000	200,365,500.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	33,843	35,500.000	1,201,426,500.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	17,637	15,030.000	265,084,110.000	
S-OIL CORP	3,165	74,700.000	236,425,500.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	7,256	29,300.000	212,600,800.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,244	37,350.000	158,513,400.000	
POSCO FUTURE M CO LTD	2,371	341,000.000	808,511,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,404	132,400.000	185,889,600.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,521	73,000.000	184,033,000.000	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,314	104,800.000	347,307,200.000	
HYUNDAI MOBIS	4,693	233,000.000	1,093,469,000.000	
SK HYNIX INC	42,467	119,200.000	5,062,066,400.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,695	35,650.000	203,026,750.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,864	103,900.000	193,669,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	10,609	189,400.000	2,009,344,600.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,036	77,100.000	156,975,600.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,149	35,550.000	254,146,950.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	11,450.000	249,438,250.000	
KIA CORPORATION	20,198	84,500.000	1,706,731,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	560	482,000.000	269,920,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	19,672	17,650.000	347,210,800.000	
KOREAN AIR CO LTD	12,758	20,450.000	260,901,100.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	131,800.000	159,346,200.000	

KT CORP	5,536	33,500.000	185,456,000.000	
HLB INC	8,598	30,350.000	260,949,300.000	
LG ELECTRONICS INC	8,232	106,600.000	877,531,200.000	
LG CORP	7,471	83,800.000	626,069,800.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,234	10,550.000	97,418,700.000	
NAVER CORP	10,182	193,000.000	1,965,126,000.000	
L&F CO LTD	2,034	157,700.000	320,761,800.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	53,200.000	183,167,600.000	
KANGWON LAND INC	9,245	14,930.000	138,027,850.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,582	507,000.000	2,830,074,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12,226	28,550.000	349,052,300.000	
COSMOAM&T CO LTD	2,095	159,100.000	333,314,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,258	511,000.000	2,175,838,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,434	138,600.000	614,552,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	372,073	68,200.000	25,375,378,600.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	49,491	7,740.000	383,060,340.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	2,572	103,600.000	266,459,200.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	63,913	54,900.000	3,508,823,700.000	
YUHAN CORP	4,477	79,500.000	355,921,500.000	
HANON SYSTEMS	13,064	9,060.000	118,359,840.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	39,550.000	150,408,650.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,254	12,580.000	229,635,320.000	
CELLTRION INC	8,473	140,900.000	1,193,845,700.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,934	51,500.000	202,601,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	22,691	42,550.000	965,502,050.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,316	179,700.000	236,485,200.000	
CELLTRION PHARM INC	1,764	65,700.000	115,894,800.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,524	71,800.000	468,423,200.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,280	113,900.000	259,692,000.000	
JYP ENTERTAINMENT CORP	2,058	107,600.000	221,440,800.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,838	142,800.000	690,866,400.000	
ECOPRO CO LTD	1,542	843,000.000	1,299,906,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	713	281,500.000	200,709,500.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	16,660	4,490.000	74,803,400.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,020	237,000.000	241,740,000.000	
SK INC	2,869	147,300.000	422,603,700.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	29,728	55,600.000	1,652,876,800.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,645	50,600.000	285,637,000.000	
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,508	40,200.000	100,821,600.000	

	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,375	53,600.000	448,900,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	574	318,000.000	182,532,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	37,800.000	209,071,800.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	3,720	61,400.000	228,408,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	715	139,200.000	99,528,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	128,800.000	259,274,400.000	
	NETMARBLE CORP	1,319	41,900.000	55,266,100.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	49,019	12,460.000	610,776,740.000	
	ECOPRO BM CO LTD	3,749	243,500.000	912,881,500.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,801	83,000.000	232,483,000.000	
	KRAFTON INC	2,300	153,200.000	352,360,000.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,996	116,000.000	231,536,000.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,878	70,300.000	132,023,400.000	
	SK SQUARE CO LTD	7,383	43,500.000	321,160,500.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	68,200.000	159,588,000.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	25,850.000	84,374,400.000	
	HYBE CO LTD	1,493	228,500.000	341,150,500.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,628	492,000.000	1,784,976,000.000	
	KAKAOBANK CORP	13,292	23,850.000	317,014,200.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,268	101,800.000	129,082,400.000	
	KAKAOPAY CORP	2,237	40,300.000	90,151,100.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,008	138,700.000	417,209,600.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,713	106,800.000	716,948,400.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,344	725,000.000	974,400,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,320	46,300.000	107,416,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,542	49,700.000	225,737,400.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,659	63,800.000	552,444,200.000	
韓国・ウォン　小計		1,244,000		82,944,850,450.000 (9,256,645,310)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	11.820	1,040,160.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	7.020	716,040.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	160,000	3.730	596,800.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	8,700	129.800	1,129,260.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	93,000	20.050	1,864,650.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,500	27.150	1,153,875.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	288,000	3.720	1,071,360.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	406,000	4.980	2,021,880.000	

YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	181,000	14.300	2,588,300.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	54,000	24.950	1,347,300.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	715,600	5.720	4,093,232.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	301,120	16.080	4,842,009.600	
CHINA RESOURCES LAND LTD	252,888	30.600	7,738,372.800	
CITIC LTD	469,000	6.990	3,278,310.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	104,000	3.360	349,440.000	
LENOVO GROUP LTD	556,000	8.520	4,737,120.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,668,000	5.720	9,540,960.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	7.980	928,792.200	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,959,200	4.160	8,150,272.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	12.940	957,560.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	221,000	9.940	2,196,740.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	63,500	63.550	4,035,425.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	282,000	6.830	1,926,060.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	94,000	4.580	430,520.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	120,200	8.710	1,046,942.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	120,000	9.910	1,189,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	4.190	1,298,900.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	101,000	4.970	501,970.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	196,800	7.410	1,458,288.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	54,500	17.420	949,390.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	491,000	9.100	4,468,100.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	65,800	22.650	1,490,370.000	
BYD CO LTD	81,500	241.200	19,657,800.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	128,000	9.420	1,205,760.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	284,592	2.690	765,552.480	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	218,000	6.150	1,340,700.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	97.000	970,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	527,788	9.770	5,156,488.760	

AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.620	792,780.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	153,200	14.660	2,245,912.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	9.000	1,710,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	578,000	12.100	6,993,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	411,000	11.900	4,890,900.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	172,400	6.780	1,168,872.000	
WEICHAI POWER CO LTD	152,440	10.580	1,612,815.200	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	7.740	882,360.000	
TINGYI HOLDING CORP	144,000	11.100	1,598,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	46,000	63.900	2,939,400.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	262,000	5.670	1,485,540.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	220,000	3.620	796,400.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	123,333	43.600	5,377,318.800	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	86,000	5.830	501,380.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	801,250	2.860	2,291,575.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	240,000	25.750	6,180,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	521,700	311.000	162,248,700.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	523,000	44.000	23,012,000.000	
LI NING CO LTD	180,500	33.550	6,055,775.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	238,000	1.710	406,980.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	438,000	2.920	1,278,960.000	
AIR CHINA / HONG KONG	156,000	5.160	804,960.000	
ZTE CORP	63,288	23.750	1,503,090.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	258,500	24.700	6,384,950.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,250	7.550	1,874,287.500	
BANK OF COMMUNICATIONS	694,205	4.740	3,290,531.700	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	142,250	7.790	1,108,127.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	64,500	14.300	922,350.000	
BAIDU INC	175,350	130.300	22,848,105.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,501,530	4.440	33,306,793.200	

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	64,200	74.550	4,786,110.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	202,000	3.060	618,120.000	
MINTH GROUP LTD	66,000	19.600	1,293,600.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	4.580	741,960.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	342,000	3.890	1,330,380.000	
BANK OF CHINA LTD	6,220,200	2.740	17,043,348.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	77,500	8.020	621,550.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	302,470	32.000	9,679,040.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,092,235	3.740	19,044,958.900	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	95,000	10.940	1,039,300.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	55,500	5.620	311,910.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	147,600	3.330	491,508.000	
CHINA COAL ENERGY CO	140,000	5.960	834,400.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	17.820	980,100.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,600	26.850	1,009,560.000	
CMOC GROUP LIMITED	315,000	5.000	1,575,000.000	
CHINA CITIC BANK-H	724,800	3.580	2,594,784.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	56,900	59.200	3,368,480.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	99,000	88.700	8,781,300.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	19.380	678,300.000	
FOSUN INTERNATIONAL	212,528	4.890	1,039,261.920	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	1.020	569,160.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	316,000	3.340	1,055,440.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,200	28.700	2,186,940.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,582,000	1.480	2,341,360.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	62,500	14.740	921,250.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	351,000	3.770	1,323,270.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	80,000	5.520	441,600.000	
DONGYUE GROUP	111,000	5.680	630,480.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	63,500	38.700	2,457,450.000	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	348,000	5.100	1,774,800.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	207,400	19.380	4,019,412.000	
CRRC CORP LTD - H	292,000	3.600	1,051,200.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	121,500	7.170	871,155.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	118,000	12.180	1,437,240.000	
SINOPHARM GROUP CO	105,200	22.000	2,314,400.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	172,000	2.010	345,720.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	214,527	3.740	802,330.980	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	204,000	6.920	1,411,680.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	246,000	6.450	1,586,700.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	70,400	11.860	834,944.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	142,400	11.160	1,589,184.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	97,000	12.560	1,218,320.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	155,000	12.940	2,005,700.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	69,000	19.180	1,323,420.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	531,656	2.590	1,376,989.040	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.310	524,370.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,298,000	2.880	6,618,240.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	73,000	20.300	1,481,900.000	
FAR EAST HORIZON LTD	120,000	5.670	680,400.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	61,200	12.120	741,744.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	146,000	15.300	2,233,800.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	170,400	4.620	787,248.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	672,000	2.780	1,868,160.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	18.060	830,760.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	241,000	3.930	947,130.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	

CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	667,000	3.870	2,581,290.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	37,000	13.420	496,540.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	88,000	21.400	1,883,200.000	
EAST BUY HOLDING LTD	32,500	35.550	1,155,375.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	175,000	7.430	1,300,250.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	41,400	18.780	777,492.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	14.940	956,160.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,522,000	0.750	2,641,500.000	
XIAOMI CORP	1,190,800	12.300	14,646,840.000	
BEIGENE LTD	53,100	110.400	5,862,240.000	
WUXI APPTEC CO LTD	28,012	98.050	2,746,576.600	
MEITUAN	394,610	116.500	45,972,065.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	89,200	16.480	1,470,016.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	21.500	2,924,000.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	5.830	2,250,380.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	93,000	42.900	3,989,700.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	500,000	0.770	385,000.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	48,000	4.170	200,160.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	91,500	6.160	563,640.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	133,000	5.840	776,720.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	88,000	10.760	946,880.000	
CHINA FEIHE LTD	271,000	4.560	1,235,760.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,278,168	84.600	108,133,012.800	
JD.COM INC	181,985	117.100	21,310,443.500	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	140,000	7.040	985,600.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	94.850	720,860.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	84,000	10.940	918,960.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	180,100	64.350	11,589,435.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	190,600	23.300	4,440,980.000	
BILIBILI INC	15,640	111.800	1,748,552.000	
AKESO INC	40,000	38.900	1,556,000.000	

	NETEASE INC	150,200	166.000	24,933,200.000	
	GDS HOLDINGS LTD	90,500	10.940	990,070.000	
	ZAI LAB LTD	70,500	19.700	1,388,850.000	
	NONGFU SPRING CO LTD	135,200	45.350	6,131,320.000	
	LI AUTO INC	87,000	137.400	11,953,800.000	
	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	89,050	39.950	3,557,547.500	
	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	30,400	45.650	1,387,760.000	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	50,800	31.300	1,590,040.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	8.500	1,386,868.500	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	116,300	49.250	5,727,775.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	35,600	23.350	831,260.000	
	JD LOGISTICS INC	140,400	9.670	1,357,668.000	
	TRIP.COM GROUP LTD	42,500	265.800	11,296,500.000	
	XPENG INC	80,300	66.200	5,315,860.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	42,000	20.300	852,600.000	
	CGN POWER CO LTD	826,000	2.010	1,660,260.000	
	GF SECURITIES CO LTD	83,200	10.180	846,976.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	36.350	1,759,340.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	115,800	9.990	1,156,842.000	
	3SBIO INC	127,500	6.730	858,075.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	95,500	5.110	488,005.000	
	CHINA LITERATURE LTD	38,600	29.150	1,125,190.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	25,000	17.600	440,000.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	100,000	8.510	851,000.000	
	BOC AVIATION LTD	18,100	52.850	956,585.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	61,200	22.700	1,389,240.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	14.520	1,422,960.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	14.020	1,721,656.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	295,500	46.950	13,873,725.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	1.990	1,034,800.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,040	30.800	1,017,632.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	19.120	1,147,200.000	
香港・ドル　小計		66,526,956		902,830,063.480 (17,225,997,614)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	38,708	536.000	20,747,488.000	

ACER INC	216,946	36.800	7,983,612.800	
ASUSTEK COMPUTER INC	54,565	376.500	20,543,722.500	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	38,886	415.500	16,157,133.000	
ASIA CEMENT CORP	158,747	40.350	6,405,441.450	
TAIWAN BUSINESS BANK	419,530	13.400	5,621,702.000	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	79,495	70.800	5,628,246.000	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	41,042	274.000	11,245,508.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	53,518	168.500	9,017,783.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	105,887	171.500	18,159,620.500	
QUANTA COMPUTER INC	210,213	238.000	50,030,694.000	
EVA AIRWAYS CORP	191,977	28.350	5,442,547.950	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	44,975	182.000	8,185,450.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	378,589	17.500	6,625,307.500	
CHINA AIRLINES	231,823	20.800	4,821,918.400	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	146,009	44.800	6,541,203.200	
CHINA STEEL CORP	899,531	24.600	22,128,462.600	
ADVANTECH CO LTD	37,817	343.500	12,990,139.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	309,005	30.800	9,517,354.000	
DELTA ELECTRONICS INC	151,836	338.500	51,396,486.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	92,348	70.700	6,529,003.600	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	295,544	116.500	34,430,876.000	
AUO CORP	526,500	15.600	8,213,400.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	139,574	95.900	13,385,146.600	
EVERGREEN MARINE CORP	77,580	103.500	8,029,530.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	225,768	29.200	6,592,425.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	190.500	7,644,955.500	
ECLAT TEXTILE CO LTD	13,716	505.000	6,926,580.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	46,832	437.000	20,465,584.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	297,323	79.600	23,666,910.800	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	282,105	61.900	17,462,299.500	
GIANT MANUFACTURING	24,172	177.000	4,278,444.000	
MEDIATEK INC	118,470	814.000	96,434,580.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	612,609	61.600	37,736,714.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	705,769	21.000	14,821,149.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	24,801	654.000	16,219,854.000	

FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	122,856	74.200	9,115,915.200	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	769,138	25.500	19,613,019.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	746,792	45.950	34,315,092.400	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,307,205	11.950	15,621,099.750	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,077,010	24.600	26,494,446.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	976,653	106.000	103,525,218.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	874,242	38.500	33,658,317.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,131	2,145.000	17,440,995.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	900,807	17.800	16,034,364.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,048,098	9.160	9,600,577.680	
INVENTEC CO LTD	216,699	48.100	10,423,221.900	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	154,957	119.500	18,517,361.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	842,432	18.250	15,374,384.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,376,473	24.900	34,274,177.700	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	831,323	26.850	22,321,022.550	
NAN YA PLASTICS CORP	368,603	66.800	24,622,680.400	
WISTRON CORP	201,828	98.200	19,819,509.600	
POU CHEN CORP	168,225	29.250	4,920,581.250	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	370,940	70.000	25,965,800.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,363	260.500	12,077,561.500	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	87,341	81.400	7,109,557.400	
E INK HOLDINGS INC	69,588	181.000	12,595,428.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	35.350	4,295,625.950	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	87,335	67.500	5,895,112.500	
TAIWAN CEMENT CORP	515,955	33.100	17,078,110.500	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,917,098	544.000	1,042,901,312.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	867,784	46.900	40,699,069.600	
WAN HAI LINES LTD	51,482	45.250	2,329,560.500	
WALSIN LIHWA CORP	237,342	37.250	8,840,989.500	
WINBOND ELECTRONICS CORP	211,880	27.950	5,922,046.000	
YAGEO CORP	25,681	527.000	13,533,887.000	

	YANG MING MARINE TRANSPORT	152,894	42.550	6,505,639.700	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	30.300	4,407,589.500	
	GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,575.000	10,873,800.000	
	INNOLUX CORPORATION	691,396	12.250	8,469,601.000	
	WPG HOLDINGS CO LTD	113,334	64.800	7,344,043.200	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	17,565	260.000	4,566,900.000	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	4,925	2,240.000	11,032,000.000	
	PEGATRON CORP	160,827	78.100	12,560,588.700	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,044	1,010.000	11,154,440.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	117,018	183.500	21,472,803.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,851	1,080.000	6,319,080.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	44,218	100.500	4,443,909.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	784,173	26.100	20,466,915.300	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	304,495	44.350	13,504,353.250	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	4,834	1,625.000	7,855,250.000	
	WIWYNN CORP	7,037	1,625.000	11,435,125.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	237,157	115.500	27,391,633.500	
	SILERGY CORP	24,347	297.500	7,243,232.500	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	211,480	27.050	5,720,534.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	17,593	316.000	5,559,388.000	
	MOMO.COM INC	6,487	540.000	3,502,980.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	17,128	471.500	8,075,852.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	13,056	309.000	4,034,304.000	
台湾・ドル　小計		27,033,347		2,480,903,279.030 (11,525,036,183)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	8,878	160.540	1,425,274.120	
	BIDVEST GROUP LTD	23,375	280.420	6,554,817.500	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	259.670	4,984,625.320	
	DISCOVERY LTD	43,836	136.890	6,000,710.040	
	GOLD FIELDS LTD	68,482	243.390	16,667,833.980	
	REMGRO LTD	42,134	155.200	6,539,196.800	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	43,521	85.580	3,724,527.180	
	EXXARO RESOURCES LTD	18,171	179.660	3,264,601.860	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,634	1,810.020	12,007,672.680	
	MTN GROUP LTD	129,887	111.800	14,521,366.600	
	FIRSTRAND LTD	391,514	62.910	24,630,145.740	

	NASPERS LTD	15,238	3,197.340	48,721,066.920	
	NEDBANK GROUP LTD	36,051	207.010	7,462,917.510	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,695	703.280	3,301,899.600	
	SASOL LTD	43,946	257.030	11,295,440.380	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	37,369	246.000	9,192,774.000	
	STANDARD BANK GROUP LTD	104,061	190.070	19,778,874.270	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,293	69.510	5,372,636.430	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	174.700	5,270,174.900	
	ABSA GROUP LTD	64,606	178.960	11,561,889.760	
	SANLAM LTD	132,946	68.690	9,132,060.740	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	69,363	91.320	6,334,229.160	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,386	460.930	2,482,568.980	
	OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	42.150	2,965,252.500	
	VODACOM GROUP PTY LTD	51,270	105.680	5,418,213.600	
	NEPI ROCKCASTLE NV	35,926	103.500	3,718,341.000	
	OLD MUTUAL LTD	391,487	12.590	4,928,821.330	
	REINET INVESTMENTS SCA	9,479	412.560	3,910,656.240	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	169,735	16.640	2,824,390.400	
	SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	27.630	6,190,197.570	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	24,305	112.620	2,737,229.100	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	34,153	356.780	12,185,107.340	
	BID CORP LTD	25,466	426.000	10,848,516.000	
南アフリカ・ランド　小計		2,452,959		295,954,029.550 (2,349,874,995)	
合計		581,781,203		75,532,418,299 (75,532,418,299)	

（２）株式以外の有価証券

2023年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	89,400.000	2,850,966.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	29,700.000	831,006.000	
		ENERGISA SA	14,000.000	637,140.000	
		KLABIN SA	59,500.000	1,382,780.000	
	ブラジル・レアル　小計		192,600.000	5,701,892.000 (168,368,888)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,171,975.000	13,419,113.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,100.000	5,850,394.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	151,200.000	29,077,272.000	
		GRUPO TELEVISA SAB	216,600.000	2,363,106.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,582,875.000	50,709,885.750 (424,568,518)	

投資信託受益証券　合計			1,775,475	592,937,406 (592,937,406)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	6,807,768.000	
	メキシコ・ペソ　小計		235,400.000	6,807,768.000 (56,998,037)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	305,735.000	3,170,471.950	
	南アフリカ・ランド　小計		305,735.000	3,170,471.950 (25,173,547)	
投資証券　合計			541,135	82,171,584 (82,171,584)	
合計				675,108,990 (675,108,990)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

2．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式　47銘柄	2.74	－	－	2.90
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式　11銘柄	1.29	－	－	1.36
インド・ルピー	株式　122銘柄	14.99	－	－	15.86
インドネシア・ルピア	株式　22銘柄	1.82	－	－	1.92
オフショア・人民元	株式　491銘柄	4.50	－	－	4.77
カタール・リアル	株式　13銘柄	0.85	－	－	0.90
クウェート・ディナール	株式　7銘柄	0.72	－	－	0.77
コロンビア・ペソ	株式　3銘柄	0.10	－	－	0.10
サウジアラビア・リアル	株式　42銘柄	3.75	－	－	3.96
タイ・バーツ	株式　41銘柄	1.75	－	－	1.85
チェコ・コルナ	株式　3銘柄	0.14	－	－	0.15
チリ・ペソ	株式　13銘柄	0.46	－	－	0.48
トルコ・リラ	株式　18銘柄	0.70	－	－	0.74
ハンガリー・フォリント	株式　3銘柄	0.23	－	－	0.24
フィリピン・ペソ	株式　14銘柄	0.58	－	－	0.61
ブラジル・レアル	株式　44銘柄 投資信託受益証券　4銘柄	4.84 －	－ 0.21	－ －	5.35
ポーランド・ズロチ	株式　15銘柄	0.76	－	－	0.80
マレーシア・リンギット	株式　32銘柄	1.32	－	－	1.40
メキシコ・ペソ	株式　18銘柄 投資信託受益証券　4銘柄	1.66 －	－ 0.53	－ －	2.39

	投資証券	1銘柄	－	－	0.07	
ユーロ	株式	11銘柄	0.42	－	－	0.45
韓国・ウォン	株式	104銘柄	11.47	－	－	12.15
香港・ドル	株式	189銘柄	21.35	－	－	22.60
台湾・ドル	株式	90銘柄	14.29	－	－	15.12
南アフリカ・ランド	株式	33銘柄	2.91	－	－	3.12
	投資証券	1銘柄	－	－	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	339,010,124
コール・ローン	610,676,823
国債証券	66,748,827,398
派生商品評価勘定	1,475,035
未収利息	896,686,534
前払費用	59,155,449
流動資産合計	68,655,831,363
資産合計	68,655,831,363
負債の部	
流動負債	
未払解約金	130,000
流動負債合計	130,000
負債合計	130,000
純資産の部	
元本等	
元本	31,852,816,892
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	36,802,884,471
元本等合計	68,655,701,363
純資産合計	68,655,701,363
負債純資産合計	68,655,831,363

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月12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	44,658,897,542円
同期中追加設定元本額	55,653,285,105円
同期中一部解約元本額	68,459,365,755円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ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）	118,455,365円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,011,008,437円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	190,731,811円
たわらノーロード　バランス（標準型）	576,508,415円
たわらノーロード　バランス（積極型）	257,226,436円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	925,501円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	5,418,955円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	68,400,495円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,528,745円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	5,770,071円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	66,339,690円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	271,810,079円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	409,214,445円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	782,669,005円
投資のソムリエ	7,847,300,173円
クルーズコントロール	264,780,018円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	690,805,683円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	309,714,130円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	722,547,381円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,596,670,642円
ワールドアセットバランス（基本コース）	379,444,078円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	677,738,889円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	60,314,202円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	30,924,745円

リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,695,719円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	226,266,616円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	740,595,125円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	225,982,841円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	69,977,595円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	32,979,378円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	20,060,780円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,743,428円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	4,373,809円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	17,255,744円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	9,014,132,472円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	227,265,658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）	497,742,019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）	133,392,502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）	3,566,148円
エマージング債券パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	7,251,205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）	117,368,969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）	59,338,715円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,095,580,778円
計	31,852,816,892円
２．　受益権の総数	31,852,816,892口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月12日現在

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△4,573,834,880
合計	△4,573,834,880

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年4月19日から2023年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	350,000,000	－	351,475,035	1,475,035
アメリカ・ドル	350,000,000	－	351,475,035	1,475,035
合計	350,000,000	－	351,475,035	1,475,035

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

値で評価しております。

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1554円 (21,554円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2023年10月12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	2,000,000.000	1,715,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	3,000,000.000	2,380,641.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	3,000,000.000	2,373,840.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	8,000,000.000	7,736,432.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	6,000,000.000	5,734,242.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	4,000,000.000	3,481,560.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,080,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	3,000,000.000	2,677,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	6,000,000.000	3,820,125.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	4,000,000.000	2,940,940.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	7,000,000.000	6,669,710.810	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	5,000,000.000	4,227,385.150	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	5,000,000.000	4,371,820.050	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	4,000,000.000	3,731,860.960	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	8,000,000.000	5,589,341.680	
		BRAZIL 6.0 10/20/33	6,000,000.000	5,663,587.380	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,604,090.860	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,593,855.920	

		CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	966,053.770	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	6,000,000.000	4,601,756.580	
		COLOMBIA 3.125 04/15/31	4,000,000.000	2,952,170.920	
		COLOMBIA 3.25 04/22/32	5,000,000.000	3,563,686.850	
		COLOMBIA 4.125 05/15/51	4,000,000.000	2,209,522.800	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	2,000,000.000	1,913,944.780	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	4,000,000.000	3,468,341.120	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	1,000,000.000	640,261.950	
		COLOMBIA 7.5 02/02/34	7,000,000.000	6,523,148.380	
		COLOMBIA 8.0 04/20/33	4,000,000.000	3,900,005.280	
		DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	5,000,000.000	4,235,075.050	
		DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	4,000,000.000	3,234,786.600	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	9,000,000.000	8,183,979.090	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	8,000,000.000	5,706,956.240	
		DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	4,200,000.000	3,686,772.180	
		DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	4,000,000.000	3,135,263.760	
		HUNGARY 2.125 09/22/31	5,000,000.000	3,684,765.000	
		HUNGARY 3.125 09/21/51	7,000,000.000	3,853,787.000	
		HUNGARY 5.25 06/16/29	6,000,000.000	5,732,550.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	3,380,000.000	3,374,240.480	
		HUNGARY 6.125 05/22/28	5,000,000.000	4,975,560.000	
		HUNGARY 6.25 09/22/32	7,000,000.000	6,734,000.000	
		INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,469,112.250	
		INDONESIA 3.05 03/12/51	4,000,000.000	2,574,189.320	
		INDONESIA 3.4 09/18/29	200,000.000	178,556.210	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	1,200,000.000	1,108,476.400	
		INDONESIA 3.85 10/15/30	3,400,000.000	3,054,307.480	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,163,709.100	
		INDONESIA 4.2 10/15/50	5,000,000.000	3,809,596.750	
		INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,545,873.050	
		INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	986,890.470	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	500,000.000	581,683.750	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	7,000,000.000	6,781,894.000	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	5,000,000.000	4,868,220.000	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	3,000,000.000	2,929,068.000	
		PANAMA 2.252 09/29/32	5,000,000.000	3,621,137.350	
		PANAMA 3.16 01/23/30	6,000,000.000	5,057,785.320	
		PANAMA 3.87 07/23/60	6,000,000.000	3,454,709.400	
		PANAMA 4.5 01/19/63	6,000,000.000	3,844,987.980	

		PANAMA 4.5 04/01/56	6,000,000.000	3,931,991.580	
		PANAMA 6.4 02/14/35	2,000,000.000	1,927,624.320	
		PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,019,544.760	
		PERU 2.392 01/23/26	3,000,000.000	2,793,301.230	
		PERU 2.78 12/01/60	5,000,000.000	2,644,688.900	
		PERU 2.783 01/23/31	4,000,000.000	3,272,631.680	
		PERU 3.0 01/15/34	6,000,000.000	4,644,925.320	
		PERU 3.55 03/10/51	4,000,000.000	2,616,708.560	
		PHILIPPINES 1.648 06/10/31	1,600,000.000	1,209,373.070	
		PHILIPPINES 2.65 12/10/45	4,000,000.000	2,427,727.520	
		PHILIPPINES 3.0 02/01/28	1,000,000.000	908,700.300	
		PHILIPPINES 3.2 07/06/46	6,000,000.000	3,976,750.920	
		PHILIPPINES 3.75 01/14/29	1,200,000.000	1,109,303.710	
		REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	4,200,000.000	3,440,812.450	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	2,200,000.000	1,766,703.750	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	2,000,000.000	1,531,638.920	
		REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	6,200,000.000	5,687,348.660	
		REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	4,000,000.000	2,257,011.240	
		REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	5,000,000.000	3,377,224.900	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	5,000,000.000	3,289,311.700	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	2,200,000.000	1,808,072.150	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,251,712.250	
		REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	5,000,000.000	4,003,142.850	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	5,000,000.000	4,800,999.400	
		ROMANIA 3.0 02/14/31	3,000,000.000	2,404,359.000	
		ROMANIA 4.0 02/14/51	10,000,000.000	6,343,040.000	
		ROMANIA 7.125 01/17/33	9,000,000.000	9,146,835.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	3,000,000.000	2,280,450.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	4,000,000.000	3,795,616.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	6,200,000.000	5,400,795.200	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	3,000,000.000	1,789,950.000	

		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	2,400,000.000	1,555,080.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	10,000,000.000	9,489,750.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,795,300.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	2,981,664.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	7,000,000.000	6,832,819.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	6,000,000.000	5,667,300.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	2,000,000.000	1,621,766.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	2,000,000.000	1,693,734.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	5,000,000.000	4,966,600.000	
		SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	5,000,000.000	4,316,900.000	
		SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	1,400,000.000	1,342,656.000	
		SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	9,000,000.000	5,977,953.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	4,000,000.000	3,559,320.000	
		SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	8,000,000.000	6,359,760.000	
		STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	6,000,000.000	5,814,600.000	
		STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	5,000,000.000	4,636,000.000	
		STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	7,000,000.000	6,640,517.870	
		STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	8,000,000.000	6,299,200.000	
		STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	9,000,000.000	7,611,624.000	
		STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	3,000,000.000	2,645,400.000	
		UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	2,000,000.000	1,233,820.000	
		UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	3,000,000.000	2,764,572.000	
		UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	4,000,000.000	3,176,152.240	
		UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,126,944.860	
		UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	3,000,000.000	2,361,259.920	

		UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,047,359.540	
		UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,366,501.520	
		UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,544,814.370	
		UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	2,000,000.000	1,487,035.460	
		UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	3,000,000.000	2,088,564.450	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	2,000,000.000	1,442,188.620	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	7,000,000.000	6,541,062.990	
		UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	2,000,000.000	1,810,608.040	
		UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	3,000,000.000	2,703,858.480	
		UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	2,000,000.000	1,542,011.600	
		UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	4,000,000.000	3,644,413.920	
		UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	3,000,000.000	2,951,696.550	
	アメリカ・ドル　小計		546,080,000.000 (81,507,900,800)	447,198,361.240 (66,748,827,398)	
国債証券　合計			81,507,900,800 (81,507,900,800)	66,748,827,398 (66,748,827,398)	
合計				66,748,827,398 (66,748,827,398)	

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

２．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券　125銘柄	97.22	100.00

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,880,981,829
投資証券	177,416,264,300
未収入金	1,004,704,801
未収配当金	2,261,763,186
前払金	179,962,430
差入委託証拠金	314,270,000
流動資産合計	184,057,946,546
資産合計	184,057,946,546
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	184,562,200
未払金	142,498,512
未払解約金	35,013,000
流動負債合計	362,073,712
負債合計	362,073,712
純資産の部	
元本等	
元本	77,400,768,007
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	106,295,104,827
元本等合計	183,695,872,834
純資産合計	183,695,872,834
負債純資産合計	184,057,946,546

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月12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	74,211,288,424円
同期中追加設定元本額	50,247,904,009円
同期中一部解約元本額	47,058,424,426円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	206,061円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	870,127円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	2,210,882円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,909,351円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	2,558,625円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,816,904円
たわらノーロード　国内リート	5,797,773,196円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	1,082,883,760円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,713,955,466円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	42,862,959円
たわらノーロード　バランス（標準型）	870,556,164円
たわらノーロード　バランス（積極型）	993,410,765円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	279,076,895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）	679,848,958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）	497,720,453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）	570,385,684円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	3,578,094円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	62,135,187円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,169,690円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	17,061,194円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,568,420円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	473,699,700円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,270,803円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	143,513,616円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	223,052,177円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	425,537,548円
投資のソムリエ	3,763,395,584円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	329,885,517円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	167,988,372円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	370,503,059円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,334,380,448円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	45,678,142円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	23,316,145円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,910,890円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	117,967,941円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	167,721,834円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	123,960,621円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	53,192,166円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	24,866,942円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	15,275,954円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,593,491円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	50,921,577円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	68,967,510円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１４０１（適格機関投資家限定）	681,519,159円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	22,099,617円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	93,676,815円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	22,380,218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）	48,629,364円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	13,696,571円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	180,661,988円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	79,695,977円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）２１－０３（適格機関投資家限定）	175,871,174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）	21,792,565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）	55,929,705円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	37,812,930円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０７（適格機関投資家限定）	62,637,230円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０８（適格機関投資家限定）	43,873,398円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	79,221,507円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	19,532,304円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０９（適格機関投資家限定）	43,727,820円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－１２（適格機関投資家限定）	62,871,915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）	232,497,783円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,153,236,815円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	108,823,529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）	75,030,853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）	416,866,344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）	36,615,128円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	1,750,367円
日米資産配分戦略ファンド（ＴＩＰＳ活用型）（為替ヘッジ比率調整型）（適格機関投資家限定）	140,506,330円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	630,201,658円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,595,232,834円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	36,072,280,042円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,585,440,123円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ専用＞	3,032,460,911円
計	77,400,768,007円
２．　受益権の総数	77,400,768,007口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月12日現在

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△2,462,974,311
合計	△2,462,974,311

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年6月7日から2023年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,443,984,930	－	5,259,737,000	△184,247,930
合計	5,443,984,930	－	5,259,737,000	△184,247,930

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年10月12日現在

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3733円 (23,733円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2023年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	7,259	1,186,846,500	
	ＧＬＰ投資法人	56,962	7,695,566,200	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	16,210	2,235,359,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	2,941	755,542,900	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	8,414	1,029,873,600	
	いちごオフィスリート投資法人	13,817	1,200,697,300	
	いちごホテルリート投資法人	2,794	305,104,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	8,847	3,644,964,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	16,545	5,542,575,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	7,389	914,758,200	
	イオンリート投資法人	20,685	3,020,010,000	
	インヴィンシブル投資法人	81,647	4,849,831,800	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,428	405,189,600	
	オリックス不動産投資法人	33,599	5,940,303,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	12,452	1,417,037,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	9,812	3,448,918,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12,380	2,843,686,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	7,331	2,150,915,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8,292	2,719,776,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,595	524,749,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,402	494,823,200	
	ザイマックス・リート投資法人	2,735	315,619,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	56,450	4,120,850,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	14,655	1,909,546,500	

	ジャパンリアルエステイト投資法人	17,322	9,960,150,000	
	スターアジア不動産投資法人	25,988	1,509,902,800	
	スターツプロシード投資法人	2,923	634,291,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	7,995	783,510,000	
	トーセイ・リート投資法人	3,551	501,401,200	
	ヒューリックリート投資法人	15,777	2,481,722,100	
	フロンティア不動産投資法人	6,257	2,856,320,500	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	4,158	599,167,800	
	マリモ地方創生リート投資法人	2,599	328,513,600	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	37,721	5,850,527,100	
	ラサールロジポート投資法人	21,556	3,132,086,800	
	阪急阪神リート投資法人	8,040	1,136,856,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,014	3,370,227,000	
	三菱地所物流リート投資法人	5,823	2,195,271,000	
	産業ファンド投資法人	25,729	3,576,331,000	
	森トラストリート投資法人	32,504	2,346,788,800	
	森ヒルズリート投資法人	19,830	2,811,894,000	
	星野リゾート・リート投資法人	3,111	1,959,930,000	
	積水ハウス・リート投資法人	50,672	4,205,776,000	
	大江戸温泉リート投資法人	2,579	165,571,800	
	大和ハウスリート投資法人	25,419	6,835,169,100	
	大和証券オフィス投資法人	3,493	2,319,352,000	
	大和証券リビング投資法人	24,834	2,714,356,200	
	投資法人みらい	21,565	1,015,711,500	
	東海道リート投資法人	2,509	312,370,500	
	東急リアル・エステート投資法人	11,306	2,048,647,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	5,823	3,639,375,000	
	日本ビルファンド投資法人	19,672	11,665,496,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	11,532	4,122,690,000	
	日本プロロジスリート投資法人	29,376	8,378,035,200	
	日本リート投資法人	5,477	1,966,243,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	10,802	3,147,702,800	
	日本都市ファンド投資法人	80,829	7,791,915,600	
	福岡リート投資法人	8,721	1,393,615,800	
	平和不動産リート投資法人	12,599	1,825,595,100	
	野村不動産マスターファンド投資法人	54,531	9,161,208,000	
投資証券　合計		1,044,278	177,416,264,300	
合計			177,416,264,300	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	258,675,652
コール・ローン	71,819,809
投資信託受益証券	7,308,617,891
投資証券	64,968,393,087
派生商品評価勘定	44,850
未収入金	382,458
未収配当金	244,280,785
流動資産合計	72,852,214,532
資産合計	72,852,214,532
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,240
未払金	169,790,531
未払解約金	1,796,000
流動負債合計	171,595,771
負債合計	171,595,771
純資産の部	
元本等	
元本	42,395,214,067
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	30,285,404,694
元本等合計	72,680,618,761
純資産合計	72,680,618,761
負債純資産合計	72,852,214,532

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月12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	32,366,670,054円
同期中追加設定元本額	45,658,651,443円
同期中一部解約元本額	35,630,107,430円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード　先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	3,092,209,203円
たわらノーロード　先進国リート（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	35,198,807円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,652,111円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	15,592,021円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	39,797,121円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	51,981,394円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	46,043,839円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	32,557,280円
たわらノーロード　先進国リート	15,055,756,338円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,607,977,922円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	302,080,066円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,857,298,738円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	30,435,168円
たわらノーロード　バランス（標準型）	618,762,213円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,303,470,013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）	97,945,443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）	697,990,482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）	601,993,157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）	1,035,352,112円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,255,197円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	52,634,819円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	7,985,816円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	31,504,173円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	1,749,353,762円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	18,376,162円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	690,947,972円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	57,534,103円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	214,120,117円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	311,322,300円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	599,057,458円
投資のソムリエ	4,726,863,932円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	415,310,597円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	240,510,446円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	399,423,601円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,436,627,978円
ワールドアセットバランス（基本コース）	318,883,562円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	571,841,781円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	58,797,408円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	30,123,722円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,146,119円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	127,121,566円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	176,171,374円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	52,951,860円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	32,146,858円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	19,543,389円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,619,239円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	93,995,340円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	304,219,665円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	343,400,619円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	217,802円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	647,540円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	125,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	285,547円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	506,310円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	136,718,784円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	1,243,561円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	572,716円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	2,188,248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）	43,632,067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）	149,898,054円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	442,581,864円
計	42,395,214,067円
２．　受益権の総数	42,395,214,067口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年10月13日 至　2023年10月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月12日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	△485,319,899
投資証券	△3,454,880,539
合計	△3,940,200,438

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年6月23日から2023年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	5,269,600	－	5,278,840	△9,240
イスラエル・シュケル	5,269,600	－	5,278,840	△9,240
買建	15,557,730	－	15,602,580	44,850
オーストラリア・ドル	5,741,340	－	5,746,086	4,746
シンガポール・ドル	9,816,390	－	9,856,494	40,104
合計	20,827,330	－	20,881,420	35,610

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.7144円
（1万口当たり純資産額）	(17,144円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2023年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	268,100.000	138,071.500	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	391,900.000	82,299.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	47,823.000	
		PRIME US REIT	317,600.000	37,476.800	
	アメリカ・ドル　小計		1,889,300.000	305,670.300 (45,624,349)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	154,926.000	164,221.560	
		ABACUS STORAGE KING	242,695.000	271,818.400	
		ARENA REIT	136,141.000	460,156.580	
		BWP TRUST	190,890.000	664,297.200	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	312,674.000	425,236.640	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	211,174.000	627,186.780	
		CENTURIA OFFICE REIT	210,931.000	240,461.340	
		CHARTER HALL GROUP	190,727.000	1,851,959.170	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	265,251.000	856,760.730	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	204,884.000	651,531.120	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	129,637.000	343,538.050	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	694,875.000	253,629.370	
		DEXUS	434,472.000	3,149,922.000	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	93,159.000	245,939.760	
		GDI PROPERTY GROUP	222,442.000	116,782.050	
		GOODMAN GROUP	690,814.000	15,280,805.680	
		GPT GROUP	775,661.000	3,017,321.290	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	101,878.000	215,981.360	
		HEALTHCO REIT	221,698.000	324,787.570	
		HMC CAPITAL LTD	95,241.000	447,632.700	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	710,956.000	835,373.300	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	236,106.750	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	148,256.000	624,157.760	
		MIRVAC GROUP	1,579,427.000	3,332,590.970	
		NATIONAL STORAGE REIT	502,275.000	1,120,073.250	
		REGION RE LTD	458,865.000	968,205.150	
		RURAL FUNDS GROUP	145,122.000	267,750.090	
		SCENTRE GROUP	2,103,154.000	5,299,948.080	
		STOCKLAND	968,794.000	3,758,920.720	

		VICINITY CENTRES	1,565,380.000	2,755,068.800	
		WAYPOINT REIT LTD	265,648.000	608,333.920	
	オーストラリア・ドル　小計		14,113,904.000	49,416,498.140 (4,733,112,192)	
	シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	264,195.000	340,811.550	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	909,616.000	823,202.480	
		CAPITALAND CHINA TRUST	505,480.000	439,767.600	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,044,209.000	3,700,018.290	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	1,442,060.000	3,879,141.400	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	258,100.000	265,843.000	
		EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	31,472.000	
		ESR LOGOS REIT	2,382,340.000	643,231.800	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	481,400.000	286,433.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	430,900.000	917,817.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,170,164.000	1,263,777.120	
		KEPPEL DC REIT	539,100.000	1,126,719.000	
		KEPPEL REIT	779,700.000	654,948.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	670,900.000	352,222.500	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	848,620.000	1,866,964.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,326,720.000	2,096,217.600	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	928,900.000	1,272,593.000	
		PARAGON REIT	487,700.000	404,791.000	
		PARKWAY LIFE REIT	153,200.000	565,308.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	259,900.000	168,935.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	550,500.000	266,992.500	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	893,790.000	1,027,858.500	
	シンガポール・ドル　小計		17,439,894.000	22,395,064.340 (2,452,931,397)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	119,540.000	154,206.600	
	ユーロ　小計		119,540.000	154,206.600 (24,446,372)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	583,000.000	2,751,760.000	
	香港・ドル　小計		583,000.000	2,751,760.000 (52,503,581)	
投資信託受益証券　合計			34,145,638	7,308,617,891 (7,308,617,891)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	37,948.000	546,071.720	

		AGREE REALTY CORP	39,002.000	2,145,500.020	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	28,861.000	472,165.960	
		ALEXANDER'S INC.	798.000	142,913.820	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	62,993.000	6,391,269.780	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	6,752.000	115,459.200	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	19,154.000	360,861.360	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	127,631.000	4,484,953.340	
		AMERICOLD REALTY TRUST	101,851.000	2,982,197.280	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	60,401.000	1,892,363.330	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	53,660.000	324,106.400	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	85,899.000	1,335,729.450	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	26,188.000	284,139.800	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	28,732.020	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	57,408.000	10,185,327.360	
		BOSTON PROPERTIES INC	57,880.000	3,298,581.200	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	63,285.570	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	66,648.000	278,588.640	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	121,887.000	2,545,000.560	
		BROADSTONE NET LEASE INC	75,452.000	1,124,989.320	
		BRT APARTMENTS CORP	6,569.000	114,760.430	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	42,845.000	4,173,959.900	
		CARETRUST REIT INC	39,935.000	865,790.800	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	9,369.000	193,282.470	
		CENTERSPACE	5,820.000	339,247.800	
		CHATHAM LODGING TRUST	22,868.000	225,249.800	
		CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	68,579.380	
		CLIPPER REALTY INC	5,086.000	25,023.120	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	94,531.000	455,639.420	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9,532.000	275,474.800	
		COPT DEFENCE PROPERTIES	45,338.000	1,130,276.340	
		COUSINS PROPERTIES INC	61,234.000	1,200,186.400	
		CTO REALTY GROUTH INC	9,356.000	154,748.240	
		CUBESMART	90,169.000	3,465,194.670	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	83,845.000	677,467.600	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	122,024.000	15,182,226.080	

		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	82,523.000	165,046.000	
		DOUGLAS EMMETT INC	66,964.000	837,050.000	
		EAST GROUP	18,423.000	3,139,647.660	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	37,022.000	427,604.100	
		ELME COMMUNITIES	34,903.000	498,763.870	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	50,702.000	405,616.000	
		EPR PROPERTIES	30,396.000	1,295,477.520	
		EQUINIX INC	37,794.000	28,514,061.240	
		EQUITY COMMONWEALTH	44,054.000	822,928.720	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	75,395.000	4,929,325.100	
		EQUITY RESIDENTIAL	139,460.000	8,470,800.400	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	63,001.000	1,372,791.790	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,968.000	5,772,686.400	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	85,402.000	10,440,394.500	
		FARMLAND PARTNERS INC	16,729.000	179,669.460	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	29,758.000	2,708,275.580	
		FIRST INDUSTRIAL RT	53,630.000	2,524,900.400	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	36,363.000	815,258.460	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	53,550.000	100,674.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	106,296.000	5,018,234.160	
		GETTY REALTY CORP	18,292.000	507,420.080	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	19,473.000	237,083.770	
		GLADSTONE LAND CORP	15,596.000	225,362.200	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	23,474.000	215,021.840	
		GLOBAL NET LEASE INC	77,900.000	647,349.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	154,360.000	2,326,205.200	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	219,508.000	3,981,875.120	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,756.000	175,429.280	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	42,458.000	847,037.100	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	285,667.000	4,619,235.390	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	49,283.000	303,090.450	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	90,587.000	1,279,088.440	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	73,653.940	

INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	11,272.000	856,784.720	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	27,005.000	687,277.250	
INVITATION HOMES INC	232,623.000	7,660,275.390	
IRON MOUNTAIN INC	118,036.000	7,180,129.880	
JBG SMITH PROPERTIES	37,467.000	547,392.870	
KILROY REALTY CORP	43,056.000	1,332,152.640	
KIMCO REALTY	248,802.000	4,329,154.800	
KITE REALTY GROUP TRUST	88,805.000	1,879,113.800	
LTC PROPERTIES INC	16,482.000	540,115.140	
LXP INDUSTRIAL TRUST	117,887.000	1,030,332.380	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	241,401.000	1,327,705.500	
MID AMERICA	47,198.000	6,325,475.960	
NATIONAL HEALTH INVS INC	17,450.000	887,158.000	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	33,441.000	1,055,397.960	
NETSTREIT CORP	26,532.000	405,939.600	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	14,807.000	124,082.660	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,928.000	280,964.160	
NNN REIT INC	73,972.000	2,645,238.720	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	105,541.440	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	98,194.000	3,370,018.080	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,132.000	154,670.640	
ORION OFFICE REIT INC	28,112.000	145,339.040	
PARAMOUNT GROUP INC	63,887.000	288,769.240	
PARK HOTELS & RESORTS INC	86,873.000	1,045,950.920	
PEAKSTONE REALTY TRUST	13,757.000	213,508.640	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	48,184.000	641,329.040	
PHILLIPS EDISON & CO INC	47,470.000	1,647,209.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	96,145.000	1,136,433.900	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,660.000	257,364.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	14,030.000	299,259.900	
POSTAL REALTY TRUST INC	10,069.000	138,549.440	
PROLOGIS INC	373,122.000	41,938,912.800	
PUBLIC STORAGE	63,936.000	17,632,270.080	
REALTY INCOME CORP	285,724.000	14,557,637.800	
REGENCY CENTERS CORP	65,933.000	3,954,002.010	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	50,366.000	611,946.900	

	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	82,845.000	4,105,798.200	
	RLJ LODGING TRUST	62,913.000	614,030.880	
	RPT REALTY	31,368.000	329,677.680	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24,174.000	2,065,426.560	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	93,324.000	1,348,531.800	
	SAFEHOLD INC	17,573.000	302,782.790	
	SAUL CENTERS INC	4,870.000	170,790.900	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	65,799.000	496,124.460	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	131,898.000	14,288,510.340	
	SITE CENTERS CORP	72,345.000	897,078.000	
	SL GREEN	25,888.000	915,399.680	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	57,224.000	1,937,032.400	
	STAG INDUSTRIAL INC	72,842.000	2,573,507.860	
	STAR HOLDINGS	5,322.000	67,695.840	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	46,872.000	272,326.320	
	SUN COMMUNITIES INC	50,336.000	5,481,590.400	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	83,079.000	786,758.130	
	TANGER FACTORY OUTLET	42,313.000	977,853.430	
	TERRENO REALTY CORP	33,974.000	1,954,524.220	
	THE MACERICH COMPANY	86,598.000	953,443.980	
	UDR INC	122,711.000	4,516,991.910	
	UMH PROPERTIES INC	23,289.000	330,936.690	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,151.000	252,252.510	
	URBAN EDGE PROPERTIES	47,155.000	726,187.000	
	VENTAS INC	162,753.000	7,016,281.830	
	VERIS RESIDENTIAL INC	31,905.000	519,413.400	
	VICI PROPERTIES INC	409,582.000	12,025,327.520	
	VORNADO REALTY TRUST	64,651.000	1,439,777.770	
	WELLTOWER INC	209,584.000	17,984,403.040	
	WHITESTONE REIT	21,086.000	206,010.220	
	WP CAREY INC	85,879.000	4,673,535.180	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	42,643.000	503,613.830	
アメリカ・ドル　小計		9,009,706.000	379,393,419.620 (56,628,261,811)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	184,841.000	92,975.020	
	AEW UK REIT PLC	78,980.000	79,611.840	
	ASSURA PLC	1,185,684.000	500,358.640	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	271,414.000	183,747.270	
	BIG YELLOW GROUP PLC	70,319.000	700,025.640	

		BRITISH LAND CO PLC	374,560.000	1,207,581.440	
		CLS HOLDINGS PLC	45,585.000	50,143.500	
		CUSTODIAN REIT PLC	207,183.000	180,870.750	
		DERWENT LONDON PLC	45,229.000	876,990.310	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	235,031.000	209,177.590	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	101,135.000	408,383.130	
		HAMMERSON PLC	1,528,866.000	380,687.630	
		HELICAL PLC	48,089.000	94,254.440	
		HOME REIT PLC	286,621.000	54,457.990	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	157,024.000	130,015.870	
		INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	305,015.000	1,858,151.380	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	171,423.000	125,824.480	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	394,814.000	697,636.330	
		LXI REIT PLC	687,704.000	634,750.790	
		NEWRIVER REIT PLC	148,157.000	118,673.750	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	208,655.000	142,302.710	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	534,149.000	497,826.860	
		PRS REIT PLC/THE	193,396.000	147,947.940	
		REGIONAL REIT LTD	236,558.000	67,182.470	
		SAFESTORE HOLDINGS LTD	87,514.000	649,791.450	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	203,492.000	85,263.140	
		SEGRO PLC	493,521.000	3,676,731.450	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	787,116.000	898,099.350	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	495,324.000	381,399.480	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	239,721.000	181,708.510	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	164,781.000	85,686.120	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	782,706.000	1,110,659.810	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	321,533.000	180,058.480	
		UNITE GROUP PLC	160,526.000	1,488,076.020	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	180,875.000	201,133.000	
		WAREHOUSE REIT PLC	161,186.000	131,044.210	
		WORKSPACE GROUP PLC	53,545.000	257,016.000	
イギリス・ポンド　小計			12,063,312.000	18,766,244.790 (3,449,235,792)	
イスラエル・シュケル		MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314,331.000	454,836.950	
		REIT 1 LTD	76,188.000	1,091,774.040	

	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	88,373.000	627,890.160	
イスラエル・シュケル　小計		478,892.000	2,174,501.150 (82,000,221)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	24,640.000	446,723.200	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,568.000	154,041.360	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,883.000	604,576.980	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,104.000	128,124.240	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	46,731.690	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	33,451.000	1,552,126.400	
	CHOICE PROPERTIES REIT	64,163.000	830,269.220	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	19,909.000	253,839.750	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,409.000	293,731.480	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	51,366.000	665,189.700	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	8,533.000	79,186.240	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,150.000	562,520.500	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,499.000	892,178.620	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	50,635.000	479,007.100	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	27,117.000	359,571.420	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,541.000	393,565.860	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,341.000	132,361.970	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,705.000	132,490.100	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	102,630.500	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	44,686.000	222,983.140	
	PRIMARIS REIT	19,254.000	263,587.260	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,769.000	69,698.980	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	58,253.000	1,075,350.380	
	SLATE GROCERY REIT	14,372.000	160,391.520	
	SMARTCENTRES REIT	28,159.000	651,317.670	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	21,434.000	44,368.380	
カナダ・ドル　小計		668,819.000	10,596,563.660 (1,164,138,484)	

ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	371,763.000	423,809.820	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	419,151.000	878,121.340	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	620,594.000	524,401.930	
	PRECINCT PROPERTIES	532,051.000	611,858.650	
ニュージーランド・ドル　小計		1,943,559.000	2,438,191.740 (218,998,382)	
ユーロ	AEDIFICA	19,159.000	1,004,889.550	
	ALTAREA	1,813.000	143,952.200	
	CARE PROPERTY INVEST NV	14,866.000	171,850.960	
	CARMILA SA	24,451.000	343,292.040	
	COFINIMMO SA	13,670.000	822,934.000	
	COVIVIO	19,481.000	798,721.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	16,977.000	344,633.100	
	GECINA SA	20,792.000	2,016,824.000	
	HAMBORNER REIT AG	28,831.000	185,671.640	
	ICADE	12,371.000	370,387.740	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	43,884.920	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	114,398.000	620,609.150	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	13,842.000	207,076.320	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	174,759.000	167,943.390	
	KLEPIERRE	78,974.000	1,807,714.860	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	17,863.000	98,603.760	
	MERCIALYS	36,888.000	306,170.400	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	136,577.000	1,107,639.470	
	MONTEA SCA	6,021.000	393,171.300	
	NSI NV	8,534.000	150,710.440	
	RETAIL ESTATES	4,770.000	265,689.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	40,600.000	1,880,592.000	
	VASTNED RETAIL	7,475.000	142,623.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	64,527.000	1,531,870.980	
	WERELDHAVE NV	15,643.000	225,415.630	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	11,043.000	294,295.950	
ユーロ　小計		924,880.000	15,447,166.800 (2,448,839,353)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	26,101.000	80,391,080.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	64,600.000	231,268,000.000	
	JR REIT XXVII	62,713.000	253,360,520.000	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,048.000	137,513,520.000	
	LOTTE REIT CO LTD	44,551.000	138,108,100.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	20,887.000	69,031,535.000	

		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	27,120.000	166,516,800.000	
		SK REITS CO LTD	48,785.000	208,555,875.000	
	韓国・ウォン　小計		319,805.000	1,284,745,430.000 (143,377,590)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	716,070.000	1,790,175.000	
		LINK REIT	1,029,520.000	38,812,904.000	
		PROSPERITY REIT	538,000.000	774,720.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	445,000.000	1,041,300.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,006,000.000	1,267,560.000	
	香港・ドル　小計		3,734,590.000	43,686,659.000 (833,541,454)	
投資証券　合計			29,143,563	64,968,393,087 (64,968,393,087)	
合計				72,277,010,978 (72,277,010,978)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

2．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券　5銘柄 投資証券　137銘柄	0.06 －	－ 77.91	78.41
イギリス・ポンド	投資証券　38銘柄	－	4.75	4.77
イスラエル・シュケル	投資証券　3銘柄	－	0.11	0.11
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券　31銘柄	6.51	－	6.55
カナダ・ドル	投資証券　26銘柄	－	1.60	1.61
シンガポール・ドル	投資信託受益証券　22銘柄	3.37	－	3.39
ニュージーランド・ドル	投資証券　4銘柄	－	0.30	0.30
ユーロ	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　26銘柄	0.03 －	－ 3.37	3.42
韓国・ウォン	投資証券　8銘柄	－	0.20	0.20
香港・ドル	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　5銘柄	0.07 －	－ 1.15	1.23

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	51,470,566,820円
Ⅱ　負債総額	56,752,338円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	51,413,814,482円
Ⅳ　発行済数量	37,072,808,554口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3868円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	451,600,610,012円
Ⅱ　負債総額	8,154,888,520円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	443,445,721,492円
Ⅳ　発行済数量	112,970,719,535口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9253円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	545,202,154,748円
Ⅱ　負債総額	4,182,676,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	541,019,478,748円
Ⅳ　発行済数量	446,027,404,825口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2130円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,058,737,462,984円
Ⅱ　負債総額	1,004,455,722円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,057,733,007,262円
Ⅳ　発行済数量	151,680,858,460口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.9734円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	239,418,049,613円
Ⅱ　負債総額	147,578,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	239,270,471,613円
Ⅳ　発行済数量	109,720,919,493口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1807円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	77,850,602,538円
Ⅱ　負債総額	216,024,363円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	77,634,578,175円
Ⅳ　発行済数量	52,830,229,370口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4695円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**66,803,217,968円**
Ⅱ　負債総額	**3,744,034,000円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**63,059,183,968円**
Ⅳ　発行済数量	**29,682,042,299口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.1245円**

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**181,419,770,399円**
Ⅱ　負債総額	**840,324,624円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**180,579,445,775円**
Ⅳ　発行済数量	**77,320,040,023口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.3355円**

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**68,559,960,791円**
Ⅱ　負債総額	**198,945,419円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**68,361,015,372円**
Ⅳ　発行済数量	**42,963,844,466口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.5911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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2023年10月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2023年10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、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年10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	1,479,197,039,659
追加型株式投資信託	780	14,682,815,646,282
単位型公社債投資信託	21	35,110,885,684
単位型株式投資信託	208	1,060,283,148,398
合計	1,035	17,257,406,720,023

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。

（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
ソフトウエア		3,107		3,367
ソフトウエア仮勘定		1,449		1,651
電話加入権		3		2
投資その他の資産		10,153		9,768
投資有価証券		241		182
関係会社株式		5,349		5,810
長期差入保証金		1,102		775
繰延税金資産		3,092		2,895
その他		367		104
固定資産計		15,983		15,918
資産合計		103,810		102,265

（単位：百万円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第37期（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第38期（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (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
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	(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 (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エアについては、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。 (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。
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	(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。 (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。 (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。 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。 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。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

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。** **（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。**
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項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

	第37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	－	1

（損益計算書関係）

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

（百万円）

	第37期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
受取配当金	543	2,393

※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

（株主資本等変動計算書関係）

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年6月16日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年3月31日現在）

	貸借対照表計上額（百万円）	時価（百万円）	差額（百万円）
（1）金銭の信託	30,332	30,332	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	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			
その他有価証券	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				
その他有価証券(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				
その他有価証券(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す。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

	第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 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
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 (2022年3月31日現在)	第38期 (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.発生したのれんの金額	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。

(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		1,055
建物	※1	947
器具備品	※1	100
リース資産	※1	6
無形固定資産		4,959
ソフトウエア		2,954
ソフトウエア仮勘定		2,002
電話加入権		2
投資その他の資産		8,557
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

1．有価証券の評価基準及び評価方法	（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 （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） 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法
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	（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。 建物　…　8～18年 器具備品　…　2～20年 （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エアについては、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。 （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。
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、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。
5．引当金の計上基準	（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。 （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。 （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。 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。 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。 （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。

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 A種種類株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第39期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

1.金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

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

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

（有価証券関係）

第39期中間会計期間末
（2023年9月30日現在）

1.子会社株式及び関連会社株式

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

2.その他有価証券

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

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

（持分法損益等）

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

（企業結合等関係）

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

1.結合当事企業

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

2.企業結合日

2016年10月1日

3.企業結合の方法

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

4.結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5.企業結合の主な目的

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

6.合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7.交付した株式数

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

8.経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9.取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10.会計処理

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

11.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a.発生したのれんの金額	**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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社の関連会社である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。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2023年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958	日本において銀行業務を営んでおります。
ソニー銀行株式会社	38,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社足利銀行	135,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社常陽銀行	85,113	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉銀行	145,069	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉興業銀行	62,120	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山銀行	6,730	日本において銀行業務を営んでおります。
スルガ銀行株式会社	30,043	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十六銀行	36,839	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社三十三銀行	37,400	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社筑邦銀行	8,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十八親和銀行	36,878	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社肥後銀行	18,128	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社鹿児島銀行	18,130	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北洋銀行	121,101	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北日本銀行	7,761	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社栃木銀行	27,408	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京葉銀行	49,700	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社神奈川銀行	6,191	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社福邦銀行	9,800	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社愛媛銀行	21,367	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社沖縄海邦銀行	4,500	日本において銀行業務を営んでおります。

信金中央金庫	（※1）690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一勧業信用組合	（※1）16,564	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
近畿産業信用組合	（※1）25,728	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
アイザワ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ａｕカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
池田泉州ＴＴ証券株式会社	1,250	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三証券株式会社	5,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
長野證券株式会社	600	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
九州ＦＧ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岩井コスモ証券株式会社	13,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
北洋証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ちばぎん証券株式会社	4,374	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	（※2）19,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東武証券株式会社	420	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
西村証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
日産証券株式会社	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
三津井証券株式会社	558	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＰａｙＰａｙ証券株式会社	（※3）15,225	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2023年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

（※1）出資の総額

（※2）2022年12月31日現在

（※3）2023年4月30日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

委託会社は、三津井証券株式会社の株式を5.7%保有しています。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

②請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨

・目論見書の使用開始日

・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２３年１２月８日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード　バランス（８資産均等型）の２０２２年１０月１３日から２０２３年１０月１２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、たわらノーロード　バランス（８資産均等型）の２０２３年１０月１２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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

２０２３年１１月２２日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　京　事　務　所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重　俊寛
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川　敬
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	稲葉　宏和

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。