

**【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6月19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】	Oneグローバルバランス
【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】

Oneグローバルバランス

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

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

（５）【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2024年6月20日から2024年12月17日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

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

（９）【払込期日】

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

（10）【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時まで(2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。)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したお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

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

### 振替受益権について

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

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

#### (参考)

##### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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。

当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

## 1 国内外の株式、公社債の4資産に分散投資します。

●上記資産に関しては、マザーファンド(\*)を通じて実質的に投資します。

(\*)ファンドが投資するマザーファンド(「主要投資対象マザーファンド」といいます。)は以下のとおりです。

- ・国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・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
- ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

また、「DIAMマネーマザーファンド」および短期金融資産に直接投資する場合があります。(「主要投資対象マザーファンド」および「DIAMマネーマザーファンド」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。)

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

## 2 主要投資対象マザーファンドへの投資割合については、公的年金の基本ポートフォリオ(\*)を考慮しつつ、投資環境分析による各資産の魅力度判定に応じた機動的な変更を行うことで、信託財産の成長をめざします。

(\*)国民年金、厚生年金の積立金を運用している、年金積立金管理運用独立行政法人(Government Pension Investment Fund 以下「GPIF」といいます。)の基本ポートフォリオです。

※当ファンドは、アセットマネジメントOneがGPIFの基本ポートフォリオを考慮しつつ、独自に資産配分比率を決定するものであり、GPIFと何ら関係を有するものではありません。

※当ファンドの運用は、GPIFの運用成果に連動することをめざすものではありません。

※GPIFの基本ポートフォリオの資産構成が変更される場合や、GPIFの基本ポートフォリオが参照できなくなる場合などは運用方法を変更することがあります。

## 3 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。

## 運用プロセス

## 公的年金のポートフォリオを参照

⇒公的年金の基本ポートフォリオを参考に  
基本配分比率を決定

## 投資環境分析を実施

⇒基本配分比率から  
機動的に配分比率を変更

## ポートフォリオの構築

## STEP1

「国内株式」、「外国株式」、「国内債券」および「外国債券」の各資産（以下「各資産」といいます。）について、年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）の基本ポートフォリオを参考に、基本配分比率を決定します。

## STEP2

マクロ経済の各種指標から世界景気の状態（景気サイクル）を判定する「経済環境分析」と、金融市場の各種指標から金融市場の状態を判定する「市場環境分析」により、投資環境を分析します。この結果をもとに各資産の魅力度を判定し、魅力度に応じて各資産への配分比率を基本配分比率から機動的に変更します。

## STEP3

STEP1～2で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。

※STEP2において各資産の魅力度が低いと判断する場合、各資産への配分比率を引き下げ、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産への投資割合を増加させます。

## ■ 分配方針

年1回の決算時（毎年9月16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。

## &lt; 商品分類 &gt;

## ・ 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## ・ 商品分類定義

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



## &lt; 属性区分 &gt;

## ・ 属性区分表

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

(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（株式、債券）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年 1 回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替の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/>）をご覧ください。

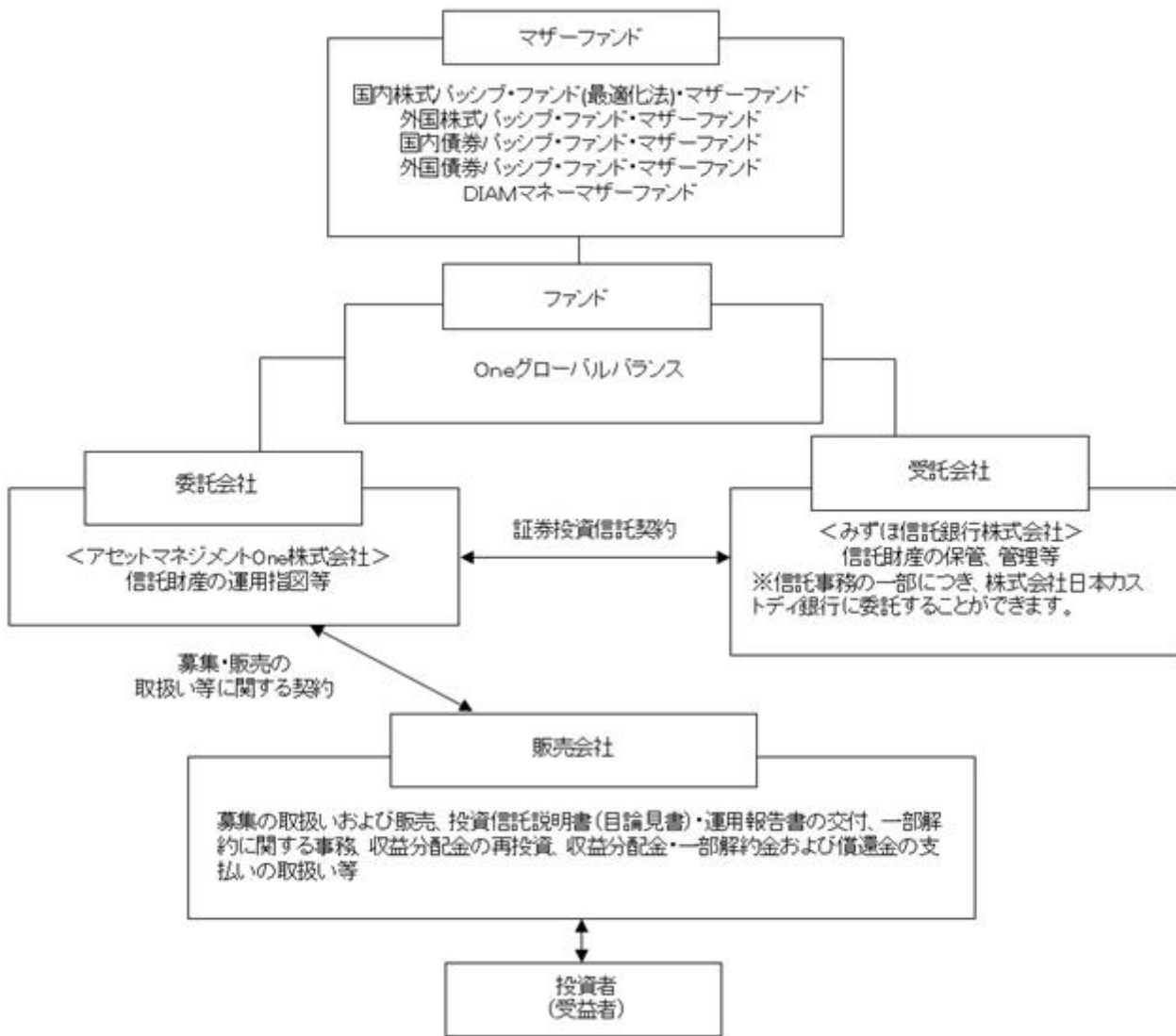
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式、債券を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## （2）【ファンドの沿革】

2021年 9月16日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2023年12月20日 信託期間を2051年9月15日までに変更（当初は2031年9月12日まで）

## (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マザーファンドにて行う仕組みです。



当ファンドは、D I A Mマネーマザーファンドおよび短期金融資産に直接投資する場合があります。

#### 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

#### 資本金の額

20億円（2024年3月29日現在）

#### 委託会社の沿革

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

#### 大株主の状況

(2024年3月29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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

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、外国株式パッシブ・ファンド・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、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、DIAMマネーマザーファンド受益証券や短期金融資産にも投資を行います。

#### <投資態度>

以下のマザーファンド（主要投資対象マザーファンドといいます。）受益証券への投資を通じて、国内外の株式および公社債に実質的に投資を行います。

- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・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
- ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

なお、DIAMマネーマザーファンド受益証券や短期金融資産にも投資を行います。

（上記のマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

主要投資対象マザーファンド受益証券の投資割合については、公的年金が基本ポートフォリオで定める資産構成割合や、投資環境分析等を勘案のうえ決定します。

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。

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】

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せん。)

八.金銭債権

二.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(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、外国株式パッシブ・ファンド・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、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、DIAMマネー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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうち、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.~11.の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、次の15.で定めるものを除きます。)

15. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
  18. 預託証券または預託証書(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、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 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 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。

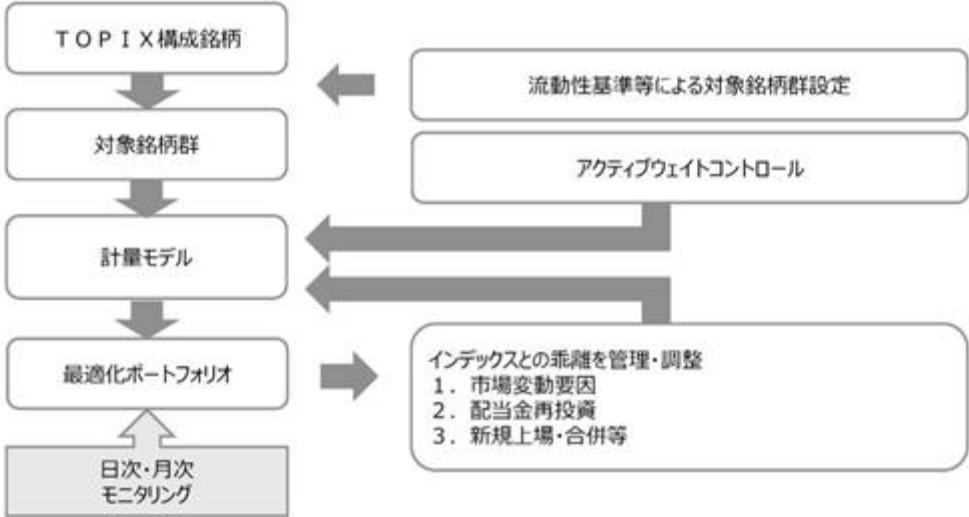
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

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



投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li><li>3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li><li>5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li></ol> <p>東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p> <p>JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</p>
------	---

運用プロセス	<p>1.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。</p> <p>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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理  日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul> 
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	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	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベ-ス、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>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。</li></ol>
------	--

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

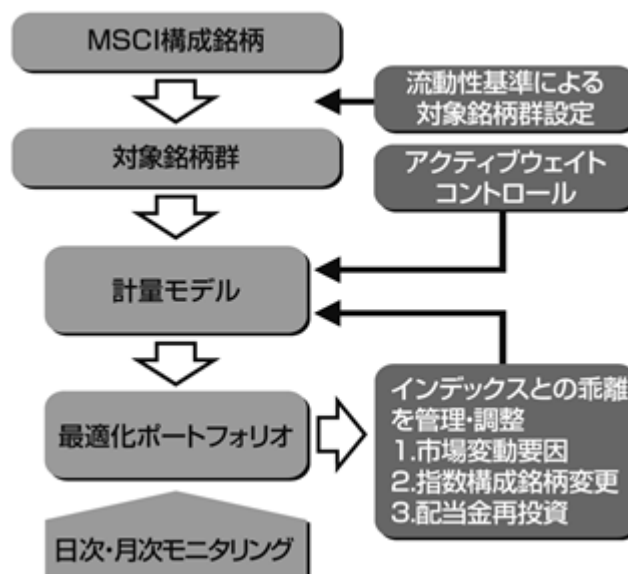
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

### 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。

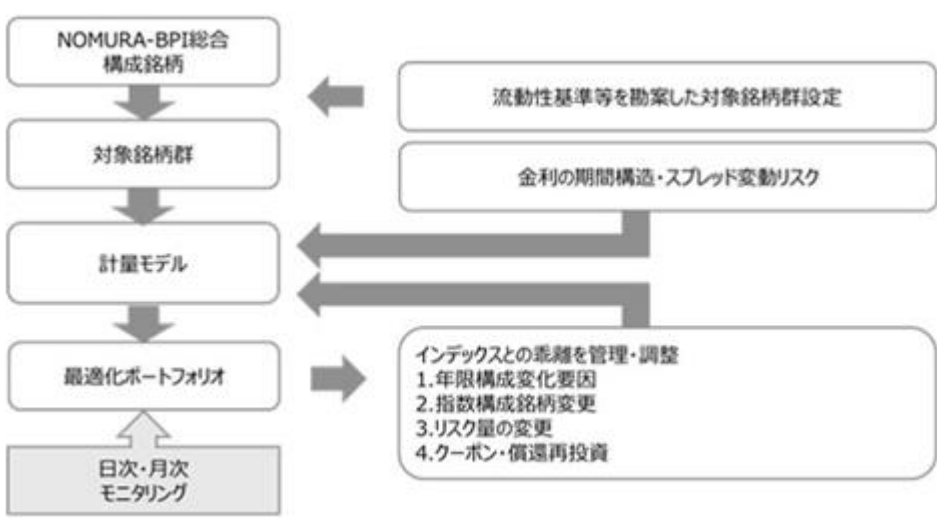
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・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	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>
--------	--

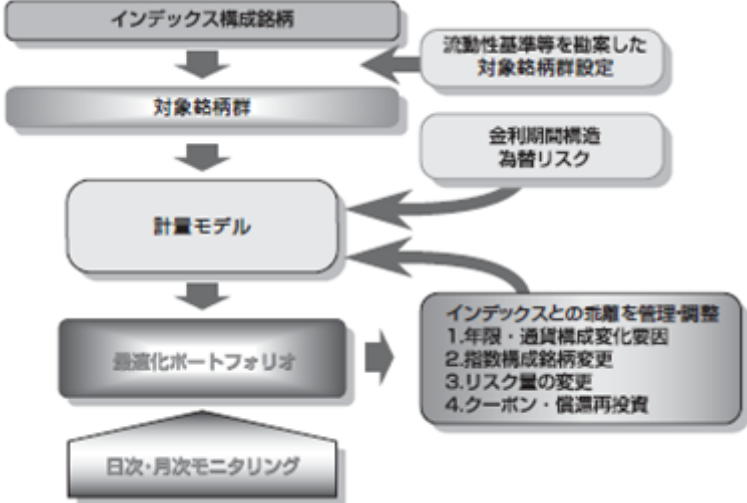
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>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。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&amp;コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&amp;コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資</p> 
--------	---



主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。</li> <li>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>
--------	---

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	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 年限・通貨構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン・償還再投資</li> </ul> 
--------	--

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li><li>2. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li><li>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li><li>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li><li>5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li><li>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li><li>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li></ol>
--------	---

ファンド名	D I A Mマナーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにC D、C P、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（*）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がA A -格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のC D、C Pを主要投資対象とします。</p> <p>（*）主要格付機関とは、R &amp; I、J C R、M o o d y ' s、S &amp; Pとします。</p> <p>2. 国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>3. ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。
主な投資制限	<p>1. 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>4. 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>5. 投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>6. 外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>7. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

定期的に関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。

## 内部管理等のモニタリング

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

#### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2024年3月29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】

#### 収益分配方針

毎決算時(原則として毎年9月16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。

#### 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る。

(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。

#### 収益分配金の支払い

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

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

#### (5)【投資制限】

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

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)

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)

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)

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)

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)

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)

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。

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

#### 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、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 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 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 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 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図(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るときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(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るときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(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。

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るときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲(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。

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

#### 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。

#### 外国為替予約取引の指図(約款第31条)

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

#### 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。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数またはすべての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。当ファンドは、国内外の株式および公社債に資産配分を行います。配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数またはすべての資産の価値が同時に下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

### 金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

### 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは、実質組入外貨建資産について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、実質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落す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、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

### 流動性リスク

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

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

## カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

- ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。
- ・分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。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、信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、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。

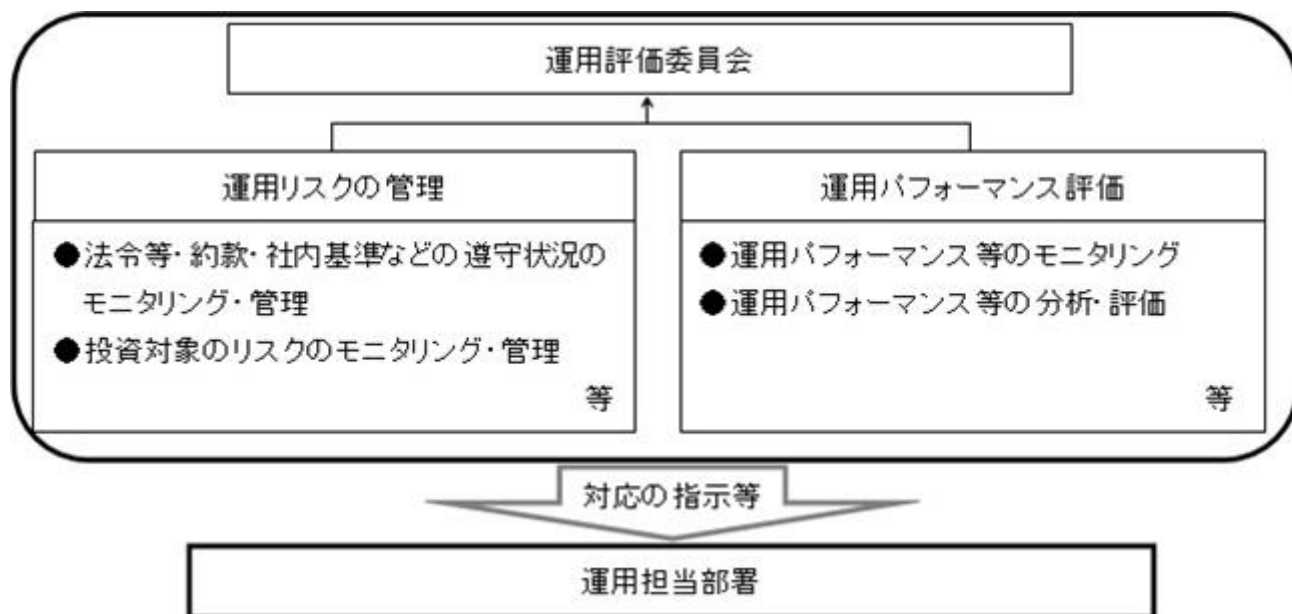
## 注意事項

- ・当ファンドは、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。
- ・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。



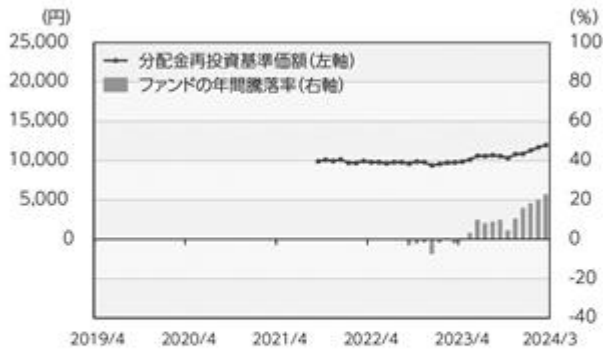
- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

リスク管理体制は2024年3月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

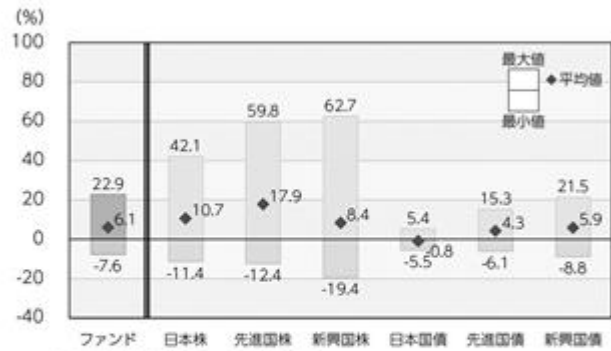


## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2022年9月~2024年3月  
代表的な資産クラス:2019年4月~2024年3月

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

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

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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.133%（税抜1.03%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.50%	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0.50%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ その他の費用

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

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。

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。

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。

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。

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

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。

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。

損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」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）」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。

上記は、2024年3月末現在のもので、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 >

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。

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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、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、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

…(参考情報)ファンドの総経費率…

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.14%	1.13%	0.01%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年9月17日~2023年9月19日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

2024年3月29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	833,231,392	97.29
内 日本	833,231,392	97.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	23,220,352	2.71
純資産総額	856,451,744	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

2024年3月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	567,037,867,660	97.64
内 日本	567,037,867,660	97.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	13,725,098,848	2.36
純資産総額	580,762,966,508	100.00

その他資産の投資状況

2024年3月29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)	14,071,600,000	2.42
内 日本	14,071,600,000	2.42

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,393,628,146,220	95.89
内 アメリカ	1,013,377,481,288	69.73
内 イギリス	52,194,238,119	3.59
内 カナダ	47,221,450,561	3.25
内 フランス	43,214,061,489	2.97
内 スイス	41,911,865,495	2.88
内 ドイツ	34,057,539,217	2.34
内 オランダ	28,859,320,356	1.99
内 アイルランド	26,759,727,670	1.84
内 オーストラリア	25,934,244,570	1.78
内 デンマーク	14,306,050,131	0.98
内 スウェーデン	12,114,269,756	0.83
内 スペイン	10,186,431,565	0.70
内 イタリア	7,887,921,947	0.54
内 香港	5,352,313,504	0.37
内 ジャージー	4,348,469,659	0.30
内 シンガポール	4,080,653,452	0.28

内	フィンランド	3,769,947,237	0.26
内	ベルギー	2,972,824,141	0.20
内	イスラエル	2,922,869,152	0.20
内	ノルウェー	2,344,342,780	0.16
内	オランダ領キュラソー	1,809,051,509	0.12
内	バミューダ	1,788,241,164	0.12
内	ケイマン諸島	1,706,330,321	0.12
内	ニュージーランド	1,041,767,142	0.07
内	リベリア	788,523,693	0.05
内	ルクセンブルグ	786,523,025	0.05
内	オーストリア	743,078,745	0.05
内	ポルトガル	633,652,715	0.04
内	パナマ	367,167,239	0.03
内	マン島	147,788,578	0.01
新株予約権証券		0	0.00
内	カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		2,369,257,823	0.16
内	オーストラリア	1,868,952,438	0.13
内	シンガポール	500,305,385	0.03
投資証券		24,917,752,571	1.71
内	アメリカ	23,462,455,517	1.61
内	フランス	541,160,800	0.04
内	イギリス	438,026,670	0.03
内	香港	266,899,801	0.02
内	ベルギー	134,084,973	0.01
内	カナダ	75,124,810	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		32,380,317,301	2.23
純資産総額		1,453,295,473,915	100.00

## その他資産の投資状況

2024年3月29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）	34,497,746,661	2.37	
内	アメリカ	26,483,891,505	1.82
内	ドイツ	4,867,155,678	0.33
内	イギリス	1,389,993,477	0.10
内	カナダ	1,109,866,311	0.08
内	オーストラリア	646,839,690	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。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
国債証券	453,859,847,150	84.72	
内	日本	453,859,847,150	84.72
地方債証券	28,444,179,982	5.31	
内	日本	28,444,179,982	5.31

特殊債券		27,883,987,009	5.20
	内 日本	27,883,987,009	5.20
社債券		23,592,206,800	4.40
	内 日本	23,197,347,800	4.33
	内 フランス	394,859,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,941,557,149	0.36
純資産総額		535,721,778,090	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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	255,832,575,346	98.32
内 アメリカ	121,069,544,639	46.53
内 中国	22,026,230,159	8.46
内 フランス	20,420,441,686	7.85
内 イタリア	18,620,332,527	7.16
内 ドイツ	16,111,771,961	6.19
内 イギリス	13,286,641,260	5.11
内 スペイン	12,420,749,019	4.77
内 カナダ	5,277,640,836	2.03
内 ベルギー	4,521,535,711	1.74
内 オランダ	3,804,646,040	1.46
内 オーストラリア	3,489,551,442	1.34
内 オーストリア	3,082,140,913	1.18
内 メキシコ	2,297,226,279	0.88
内 ポーランド	1,411,652,484	0.54
内 フィンランド	1,349,616,576	0.52
内 アイルランド	1,309,005,511	0.50
内 マレーシア	1,235,206,625	0.47
内 シンガポール	1,046,653,025	0.40
内 イスラエル	828,982,277	0.32
内 デンマーク	681,060,688	0.26
内 ニュージーランド	618,940,275	0.24
内 スウェーデン	488,294,147	0.19
内 ノルウェー	434,711,266	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,374,037,626	1.68
純資産総額	260,206,612,972	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】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

2024年3月29日現在

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



1	国内株式パッシブ・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	50,926,367	4.2596	4.8777	-	29.00
				216,928,388	248,403,540	-	
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	27,852,346	7.6200	8.8697	-	28.84
				212,235,904	247,041,953	-	
3	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	73,735,304	2.2408	2.3583	-	20.30
				165,230,748	173,889,967	-	
4	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	132,505,403	1.2361	1.2369	-	19.14
				163,795,084	163,895,932	-	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.29
合計	97.29

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資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

2024年3月29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	7,955,700	3,260.00 25,935,582,000	3,792.00 30,168,014,400	- -	5.19
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,690,000	1,404.00 12,200,760,000	1,557.00 13,530,330,000	- -	2.33
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,024,900	14,300.00 14,656,070,000	12,985.00 13,308,326,500	- -	2.29
4	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	306,700	28,480.00 8,734,816,000	39,570.00 12,136,119,000	- -	2.09
5	三菱商事 日本	株式 卸売業	2,943,300	2,782.00 8,188,260,600	3,487.00 10,263,287,100	- -	1.77
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	145,000	64,180.00 9,306,100,000	69,540.00 10,083,300,000	- -	1.74
7	日立製作所 日本	株式 電気機器	703,300	11,720.00 8,242,676,000	13,905.00 9,779,386,500	- -	1.68
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,014,600	7,687.00 7,799,230,200	8,909.00 9,039,071,400	- -	1.56
9	信越化学工業 日本	株式 化学	1,301,400	5,828.00 7,584,559,200	6,584.00 8,568,417,600	- -	1.48

10	三井物産 日本	株式 卸売業	1,148,100	5,840.00 6,704,904,000	7,106.00 8,158,398,600	- -	1.40
11	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	43,224,000	183.40 7,927,281,600	179.80 7,771,675,200	- -	1.34
12	任天堂 日本	株式 その他製 品	914,700	8,369.00 7,655,124,300	8,196.00 7,496,881,200	- -	1.29
13	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービス 業	1,102,700	5,783.00 6,376,914,100	6,707.00 7,395,808,900	- -	1.27
14	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,030,500	6,736.00 6,941,448,000	6,466.00 6,663,213,000	- -	1.15
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,410,500	3,878.00 5,469,919,000	4,703.00 6,633,581,500	- -	1.14
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	3,433,200	1,710.50 5,872,488,600	1,891.00 6,492,181,200	- -	1.12
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	716,800	6,618.00 4,743,782,400	8,962.00 6,423,961,600	- -	1.11
18	第一三共 日本	株式 医薬品	1,265,900	4,512.00 5,711,740,800	4,777.00 6,047,204,300	- -	1.04
19	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,926,000	2,720.00 5,238,720,000	3,046.00 5,866,596,000	- -	1.01
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,286,000	4,219.00 5,425,634,000	4,184.00 5,380,624,000	- -	0.93
21	HOYA 日本	株式 精密機器	285,200	18,400.00 5,247,680,000	18,740.00 5,344,648,000	- -	0.92
22	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	1,122,900	4,599.00 5,164,217,100	4,482.00 5,032,837,800	- -	0.87
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	2,340,200	1,944.50 4,550,532,338	1,951.00 4,565,730,200	- -	0.79
24	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,628,700	2,015.00 3,281,830,500	2,512.00 4,091,294,400	- -	0.70
25	ディスコ 日本	株式 機械	70,500	42,850.00 3,020,925,000	57,190.00 4,031,895,000	- -	0.69
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス 業	788,200	5,112.00 4,029,278,400	4,849.00 3,821,981,800	- -	0.66
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,318,200	2,989.50 3,940,758,900	2,824.00 3,722,596,800	- -	0.64
28	S M C 日本	株式 機械	43,800	79,080.00 3,463,704,000	84,830.00 3,715,554,000	- -	0.64
29	三菱重工業 日本	株式 機械	2,559,000	1,036.00 2,651,124,000	1,448.50 3,706,711,500	- -	0.64
30	ダイキン工業 日本	株式 機械	174,700	21,165.00 3,697,525,500	20,600.00 3,598,820,000	- -	0.62

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	97.64
合計	97.64

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2024年3月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	16.99
輸送用機器		9.28
卸売業		7.23
銀行業		7.23
情報・通信業		7.08
化学		5.58
機械		5.48
サービス業		4.33
医薬品		4.16
小売業		4.12
食料品		3.01
保険業		2.66
陸運業		2.44
その他製品		2.23
精密機器		2.16
不動産業		2.09
建設業		2.04
電気・ガス業		1.36
その他金融業		1.17
鉄鋼		0.92
証券、商品先物取引業		0.91
非鉄金属		0.69
海運業		0.68
ガラス・土石製品		0.67
ゴム製品		0.67
石油・石炭製品		0.51
金属製品		0.50
空運業		0.40
繊維製品		0.35
鉱業		0.33
パルプ・紙		0.16
倉庫・運輸関連業	0.13	
水産・農林業	0.08	
合計	97.64	

（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。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29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	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,087,148	62,007.55 67,411,391,443	63,701.21 69,252,648,702	- -	4.77
2	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,261,698	27,882.15 63,061,006,283	25,963.78 58,722,244,677	- -	4.04
3	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	380,370	111,972.41 42,590,948,290	136,808.01 52,037,666,415	- -	3.58
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,432,341	25,898.45 37,095,418,558	27,311.33 39,119,146,031	- -	2.69
5	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	341,856	71,682.39 24,505,055,821	73,521.66 25,133,823,267	- -	1.73
6	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	912,175	22,090.63 20,150,526,693	22,852.31 20,845,307,060	- -	1.43
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	792,918	22,278.46 17,664,997,813	23,053.68 18,279,683,071	- -	1.26
8	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	124,326	114,658.54 14,255,038,882	117,790.92 14,644,474,367	- -	1.01
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	68,510	191,183.03 13,097,949,979	200,680.32 13,748,609,278	- -	0.95
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	444,827	26,661.02 11,859,541,704	30,327.42 13,490,456,590	- -	0.93
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	201,742	60,383.64 12,181,918,023	63,670.93 12,845,101,405	- -	0.88

12	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	440,906	28,595.86 12,608,089,486	26,616.36 11,735,314,541	- -	0.81
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	615,470	15,271.68 9,399,262,484	17,599.89 10,832,209,468	- -	0.75
14	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	142,800	78,234.99 11,171,957,876	74,902.52 10,696,080,855	- -	0.74
15	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	243,751	42,025.35 10,243,723,427	42,255.50 10,299,821,063	- -	0.71
16	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	502,851	18,524.46 9,315,043,664	19,282.84 9,696,397,388	- -	0.67
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	128,934	70,441.98 9,082,366,894	72,914.51 9,401,159,909	- -	0.65
18	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	62,104	139,336.58 8,653,359,132	145,642.72 9,044,995,979	- -	0.62
19	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	363,111	23,569.00 8,558,165,366	24,566.27 8,920,283,773	- -	0.61
20	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	370,879	23,589.62 8,748,897,913	23,951.54 8,883,126,133	- -	0.61
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	152,731	54,239.60 8,284,069,004	58,080.87 8,870,750,272	- -	0.61
22	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	390,800	19,052.65 7,445,775,965	19,978.54 7,807,617,144	- -	0.54
23	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	68,386	109,382.92 7,480,260,583	110,927.50 7,585,888,582	- -	0.52
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	272,283	26,412.00 7,191,540,341	27,571.76 7,507,321,800	- -	0.52
25	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	249,270	27,079.02 6,749,989,775	27,327.99 6,812,048,291	- -	0.47
26	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	148,357	43,780.20 6,495,099,353	45,601.66 6,765,326,036	- -	0.47

27	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	412,946	16,248.95 6,709,940,679	16,078.33 6,639,486,189	- -	0.46
28	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	277,081	22,864.42 6,335,297,494	23,883.41 6,617,640,068	- -	0.46
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,090,810	5,016.21 5,471,735,629	5,741.46 6,262,849,836	- -	0.43
30	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	67,648	87,716.35 5,933,836,003	91,955.83 6,220,628,346	- -	0.43

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	95.89
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.71
合計	97.77

（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。

#### 投資株式の業種別投資比率

2024年3月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	8.64
半導体・半導体製造装置		8.21
銀行		5.44
医薬品		4.91
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.55
コンピュータ・周辺機器		4.37
石油・ガス・消耗燃料		4.34
金融サービス		3.13
資本市場		3.12
大規模小売り		3.08
保険		3.05
ヘルスケア機器・用品		2.20
ホテル・レストラン・レジャー		1.98
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス		1.94
機械		1.91
化学		1.81
航空宇宙・防衛		1.74
バイオテクノロジー		1.71
生活必需品流通・小売り		1.69
専門小売り		1.67
電力		1.51
自動車		1.46
飲料		1.46
情報技術サービス		1.32
金属・鉱業		1.32
食品		1.26

ライフサイエンス・ツール/サービス	1.20
繊維・アパレル・贅沢品	1.15
陸上運輸	1.08
娯楽	1.08
家庭用品	0.99
専門サービス	0.96
電気設備	0.94
コングロマリット	0.94
各種電気通信サービス	0.89
総合公益事業	0.67
通信機器	0.64
建設関連製品	0.63
商業サービス・用品	0.61
メディア	0.60
パーソナルケア用品	0.56
商社・流通業	0.50
電子装置・機器・部品	0.49
タバコ	0.48
航空貨物・物流サービス	0.44
消費者金融	0.40
建設資材	0.34
建設・土木	0.32
家庭用耐久財	0.31
不動産管理・開発	0.30
エネルギー設備・サービス	0.25
容器・包装	0.21
無線通信サービス	0.20
自動車用部品	0.14
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12
運送インフラ	0.10
販売	0.09
ガス	0.09
水道	0.09
紙製品・林産品	0.08
ヘルスケア・テクノロジー	0.06
旅客航空輸送	0.05
海上運輸	0.04
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.01
合計	95.89

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29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	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	10,400,000,000	99.26 10,323,490,000	99.31 10,328,552,000	0.1 2028/3/20	1.93

2	456回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	9,300,000,000	99.86 9,287,805,000	99.89 9,290,235,000	0.1 2026/1/1	1.73
3	450回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	8,800,000,000	99.90 8,791,816,000	99.91 8,792,784,000	0.005 2025/7/1	1.64
4	358回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	7,750,000,000	98.15 7,607,110,000	98.28 7,616,700,000	0.1 2030/3/20	1.42
5	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	7,300,000,000	100.04 7,303,431,000	100.01 7,301,022,000	0.1 2025/9/20	1.36
6	156回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	7,200,000,000	99.73 7,180,872,000	99.81 7,186,680,000	0.2 2027/12/20	1.34
7	160回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	7,100,000,000	99.55 7,068,195,000	99.62 7,073,304,000	0.2 2028/6/20	1.32
8	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,820,000,000	98.76 6,735,472,000	99.00 6,752,277,400	0.5 2032/12/20	1.26
9	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,900,000,000	96.74 6,675,173,000	96.98 6,691,620,000	0.2 2032/6/20	1.25
10	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,280,000,000	97.02 6,093,089,000	97.21 6,105,227,600	0.2 2032/3/20	1.14
11	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,900,000,000	98.57 5,816,189,000	98.77 5,827,430,000	0.5 2033/3/20	1.09
12	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,950,000,000	96.81 5,760,251,000	96.94 5,768,168,000	0.1 2031/9/20	1.08
13	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,210,000,000	99.41 5,179,677,800	99.32 5,174,988,800	0.005 2027/6/20	0.97
14	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,950,000,000	99.00 4,900,648,500	99.03 4,901,985,000	0.1 2028/9/20	0.92
15	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,890,000,000	99.90 4,885,110,000	99.75 4,878,068,400	0.1 2026/12/20	0.91
16	373回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	98.89 4,747,067,000	98.86 4,745,472,000	0.6 2033/12/20	0.89
17	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,700,000,000	99.99 4,699,530,000	99.92 4,696,334,000	0.1 2025/12/20	0.88
18	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,750,000,000	96.37 4,577,860,000	96.73 4,594,960,000	0.2 2032/9/20	0.86



19	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,540,000,000	99.84 4,533,008,400	99.70 4,526,607,000	0.1 2027/3/20	0.84
20	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	99.73 4,488,030,000	99.63 4,483,440,000	0.1 2027/6/20	0.84
21	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,470,000,000	97.04 4,337,874,000	97.21 4,345,376,400	0.1 2031/6/20	0.81
22	372回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	100.71 4,129,376,000	101.02 4,141,902,000	0.8 2033/9/20	0.77
23	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,210,000,000	97.32 4,097,466,700	97.47 4,103,529,100	0.1 2031/3/20	0.77
24	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,090,000,000	99.94 4,087,586,900	99.82 4,082,760,700	0.1 2026/6/20	0.76
25	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,130,000,000	98.61 4,072,634,300	98.59 4,071,849,600	0.1 2029/6/20	0.76
26	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,070,000,000	99.62 4,054,737,500	99.55 4,051,766,400	0.1 2027/9/20	0.76
27	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	97.82 4,010,661,000	97.92 4,014,802,000	0.1 2030/9/20	0.75
28	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,980,000,000	100.48 3,999,462,200	100.41 3,996,477,200	0.4 2025/6/20	0.75
29	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,050,000,000	98.05 3,971,146,500	98.11 3,973,819,500	0.1 2030/6/20	0.74
30	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	97.57 3,903,124,000	97.71 3,908,640,000	0.1 2030/12/20	0.73

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.72
地方債証券	5.31
特殊債券	5.20
社債券	4.40
合計	99.64

(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。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証券	1,428,876,260	101.30 1,447,488,206	101.42 1,449,240,890	2.69 2026/8/12	0.56
2	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	1,303,901,660	101.61 1,324,907,050	101.79 1,327,368,890	2.68 2030/5/21	0.51
3	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,556,494,800	83.84 1,305,086,023	84.48 1,314,964,502	1.875 2032/2/15	0.51
4	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,583,748,600	80.84 1,280,422,132	81.47 1,290,414,855	1.25 2031/8/15	0.50
5	US T N/B 1.0 07/31/28 アメリカ	国債証券	1,403,570,700	86.83 1,218,748,943	87.15 1,223,299,587	1 2028/7/31	0.47
6	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,211,280,000	96.78 1,172,291,925	97.36 1,179,389,274	3.875 2033/8/15	0.45
7	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	1,124,771,400	101.94 1,146,660,238	102.09 1,148,386,762	3.03 2026/3/11	0.44
8	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,323,323,400	83.71 1,107,843,960	84.30 1,115,571,955	1.625 2031/5/15	0.43
9	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,218,850,500	90.24 1,099,941,162	90.81 1,106,868,610	2.875 2032/5/15	0.43
10	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,346,034,900	81.03 1,090,745,513	81.70 1,099,726,282	1.375 2031/11/15	0.42
11	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,315,752,900	81.48 1,072,184,263	82.02 1,079,277,153	1.125 2031/2/15	0.41
12	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,075,011,000	98.77 1,061,849,560	99.33 1,067,851,254	4.125 2032/11/15	0.41
13	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,187,054,400	89.08 1,057,498,545	89.70 1,064,871,255	2.75 2032/8/15	0.41
14	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,314,238,800	80.42 1,057,011,639	80.96 1,064,071,391	0.875 2030/11/15	0.41
15	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証券	1,041,455,000	100.02 1,041,714,198	100.23 1,043,902,731	2.18 2026/8/15	0.40
16	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,097,722,500	94.12 1,033,254,518	94.72 1,039,834,782	3.5 2033/2/15	0.40
17	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	1,031,040,450	100.31 1,034,275,210	100.54 1,036,699,727	2.3 2026/5/15	0.40
18	US T N/B 2.0 11/15/26 アメリカ	国債証券	1,064,412,300	93.83 998,799,362	93.89 999,424,935	2 2026/11/15	0.38
19	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	1,059,870,000	93.05 986,299,217	93.69 993,069,211	3.375 2033/5/15	0.38
20	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 中国	国債証券	958,138,600	103.03 987,256,144	103.11 987,937,764	3.01 2028/5/13	0.38

21	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,171,913,400	79.50 931,671,153	80.10 938,766,720	0.625 2030/8/15	0.36
22	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証券	908,460,000	98.40 893,981,418	98.28 892,916,812	3.75 2026/4/15	0.34
23	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	943,527,200	92.35 871,405,867	92.63 874,077,936	1.5 2031/5/25	0.34
24	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	922,086,900	94.44 870,867,847	94.57 872,092,498	1.625 2026/2/15	0.34
25	US T N/B 2.75 04/30/27 アメリカ	国債証券	908,460,000	95.22 865,095,225	95.25 865,308,150	2.75 2027/4/30	0.33
26	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	1,067,440,500	80.19 856,058,096	80.78 862,333,471	0.625 2030/5/15	0.33
27	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	913,002,300	93.10 850,053,587	93.21 851,018,006	1.5 2026/8/15	0.33
28	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証券	908,460,000	92.22 837,805,939	92.39 839,402,846	0.75 2026/4/30	0.32
29	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	866,065,200	92.49 801,076,480	92.67 802,598,856	0.75 2026/3/31	0.31
30	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	869,093,400	92.13 800,737,167	92.23 801,602,863	1.5 2027/1/31	0.31

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.32
合計	98.32

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【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。

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。

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。

#### 【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

2024年3月29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 0606月	買建	508	13,732,791,640	14,071,600,000	2.42

(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。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29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 Jun24	買建	659	26,029,307,206	26,483,891,505	1.82
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun24	買建	591	4,751,771,116	4,867,155,678	0.33
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun24	買建	91	1,346,820,782	1,389,993,477	0.10
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun24	買建	37	1,094,452,185	1,109,866,311	0.08
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Jun24	買建	33	632,735,995	646,839,690	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。

## 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。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（2024年3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 (2022年9月16日)	69	69	0.9842	0.9842
第2計算期間末 (2023年9月19日)	426	426	1.0763	1.0763
2023年3月末日	206	-	0.9754	-
4月末日	235	-	0.9884	-
5月末日	275	-	1.0132	-
6月末日	341	-	1.0611	-
7月末日	376	-	1.0588	-

8月末日	412	-	1.0686	-
9月末日	434	-	1.0566	-
10月末日	457	-	1.0328	-
11月末日	511	-	1.0832	-
12月末日	523	-	1.0882	-
2024年1月末日	634	-	1.1336	-
2月末日	728	-	1.1679	-
3月末日	856	-	1.1985	-

## 【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
2023年9月20日～2024年3月19日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.6
第2計算期間	9.4
2023年9月20日～2024年3月19日	9.5

(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	113,391,367	42,328,958
第2計算期間	527,599,029	202,667,624
2023年9月20日～ 2024年3月19日	603,475,450	312,045,502

(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。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2024年3月29日

## 基準価額・純資産の推移 (2021年9月16日～2024年3月29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:2021年9月16日)

## 分配の推移(税引前)

2022年 9月	0円
2023年 9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

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

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	29.00
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.84
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.30
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.14

## ■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	5.19
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.33
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.29
4	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	2.09
5	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.77

## ■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	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.77
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.04
3	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	3.58
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売	2.69
5	META PLATFORMS INC	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	1.73

○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:2024年3月29日

### ■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	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.93
2	456回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2026/1/1	1.73
3	450回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2025/7/1	1.64
4	358回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2030/3/20	1.42
5	145回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.36

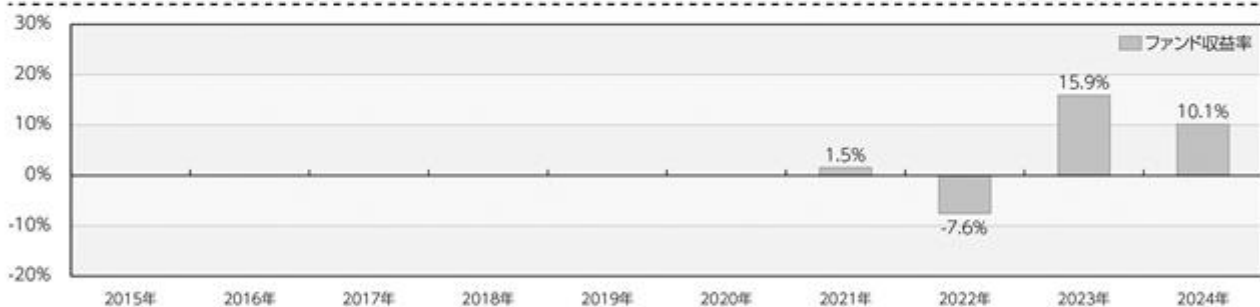
### ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	中国	2.69	2026/8/12	0.56
2	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	中国	2.68	2030/5/21	0.51
3	US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	アメリカ	1.875	2032/2/15	0.51
4	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.50
5	US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	アメリカ	1	2028/7/31	0.47

### 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。

※2021年は設定日から年末までの収益率、および2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合には、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（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）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、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

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



当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

#### ・お申込手数料

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

#### ・払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）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
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、2021年9月16日（設定日）から原則として2051年9月15日までです。

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

## (4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年9月17日から翌年9月16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、信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、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送します。
- 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、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解

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

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

#### ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a. の事項(上記a. の変更事項にあっては、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、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 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。以下ロ. 信託約款の変更等c. において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができま。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- 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であっても、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。

## 八.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。

## 二.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、2022年以降の毎年9月16日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <https://www.am-one.co.jp/>）

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金請求権

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

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

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

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

##### (2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）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2期計算期間(2022年9月17日から2023年9月19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】

## 【Oneグローバルバランス】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2022年9月16日現在	第2期 2023年9月19日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,721,093	22,784,731
親投資信託受益証券	63,563,608	409,266,239
流動資産合計	73,284,701	432,050,970
資産合計	73,284,701	432,050,970
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,957,855	4,062,281
未払受託者報酬	11,275	52,153
未払委託者報酬	377,264	1,739,667
その他未払費用	1,257	6,094
流動負債合計	3,347,651	5,860,195
負債合計	3,347,651	5,860,195
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	71,062,409	395,993,814
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,125,359	30,196,961
（分配準備積立金）	120,974	23,716,114
元本等合計	69,937,050	426,190,775
純資産合計	69,937,050	426,190,775
負債純資産合計	73,284,701	432,050,970

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2021年9月16日 至 2022年9月16日	自	2022年9月17日 至 2023年9月19日
<b>営業収益</b>				
受取利息		28		130
有価証券売買等損益		521,392		33,382,631
営業収益合計		521,364		33,382,761
<b>営業費用</b>				
支払利息		565		5,676
受託者報酬		17,311		67,989
委託者報酬		580,058		2,268,600
その他費用		1,889		7,888
営業費用合計		599,823		2,350,153
営業利益又は営業損失( )		1,121,187		31,032,608
経常利益又は経常損失( )		1,121,187		31,032,608
当期純利益又は当期純損失( )		1,121,187		31,032,608
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( )		479,957		7,044,936
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		1,125,359
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,024		7,334,648
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,024		2,681,002
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		4,653,646
剰余金減少額又は欠損金増加額		495,153		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		495,153		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,125,359		30,196,961

## (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2期	
	自 2022年9月17日	至 2023年9月19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。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年9月16日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2023年9月19日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期
	2022年9月16日現在	2023年9月19日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	71,062,409円
期中追加設定元本額	112,391,367円	527,599,029円
期中一部解約元本額	42,328,958円	202,667,624円
2. 受益権の総数	71,062,409口	395,993,814口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,125,359円であります。	-

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 2021年9月16日 至 2022年9月16日	自 2022年9月17日 至 2023年9月19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(120,974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(56,623円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は177,597円(1万口当たり24.99円)ですが、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(2,879,597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(20,785,283円)、信託約款に規定される収益調整金(6,480,847円)及び分配準備積立金(51,234円)より分配対象収益は30,196,961円(1万口当たり762.56円)ですが、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1期	第2期
	自 2021年9月16日 至 2022年9月16日	自 2022年9月17日 至 2023年9月19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1期 2022年9月16日現在	第2期 2023年9月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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1期 2022年9月16日現在	第2期 2023年9月19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	665,336	32,484,246
合計	665,336	32,484,246

（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1期 2022年9月16日現在	第2期 2023年9月19日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9842円 (9,842円)	1.0763円 (10,763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9月19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	29,688,078	124,553,362	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	16,302,221	120,142,478	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	64,140,293	79,290,230	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	38,816,645	85,280,169	
親投資信託受益証券 合計		148,947,237	409,266,239	
合計			409,266,239	

（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、「外国株式パッシブ・ファンド・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」受益証券及び「外国債券パッシブ・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9月19日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,969,968,542
株式	473,953,844,380
派生商品評価勘定	281,161,010
未収入金	320,806,180
未収配当金	183,787,515
差入委託証拠金	571,725,000
流動資産合計	489,281,292,627
資産合計	489,281,292,627
負債の部	
流動負債	
前受金	240,250,000
未払解約金	175,014,000
流動負債合計	415,264,000
負債合計	415,264,000
純資産の部	
元本等	
元本	116,525,629,287
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	372,340,399,340
元本等合計	488,866,028,627
純資産合計	488,866,028,627
負債純資産合計	489,281,292,627

## 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9月17日 至 2023年9月19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9月19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	120,884,975,987円
同期中追加設定元本額	53,073,421,182円
同期中一部解約元本額	57,432,767,882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	2,546,489,331円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,591,853,499円
One DC 国内株式インデックスファンド	28,276,814,513円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,376,212,893円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,401,759円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,675,835円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	19,608,862円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,126,491円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,073,574円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,976,986円
たわらノーロード TOPIX	1,942,281,081円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,610,631,079円
たわらノーロード バランス(堅実型)	49,741,880円
たわらノーロード バランス(標準型)	345,434,269円
たわらノーロード バランス(積極型)	578,975,930円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	3,068,454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)	166,841,314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)	442,943,778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)	361,692,356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)	514,625,363円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	373,243円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,586,376円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	33,111,866円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,907,211円



たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,972,368円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,203,468,481円
Oneグローバルバランス	29,688,078円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	962,247,528円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,458,616,954円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,893,607,432円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	300,210,941円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	998,953,688円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,098,040,857円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,264,986円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	295,917,724円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	338,088,215円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	561,245,083円
投資のソムリエ	6,971,174,391円
クルーズコントロール	431,973,592円
投資のソムリエ<DC年金>	599,475,973円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	336,574,621円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	997,876,189円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	502,349,134円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,849,445,219円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	78,205,166円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	39,494,328円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,853,561円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	78,730,005円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	495,530,175円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,047,416,295円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	236,015,559円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	83,991,108円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	42,506,678円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	26,205,565円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	453,565,273円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,970,811円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,784,652円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	41,799,935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)	38,612,768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)	39,606,413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)	35,399,792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)	24,165,962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)	38,252,845円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	98,137,051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)	175,669,633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)	34,414,809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)	149,549,760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)	456,228,866円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	197,370,553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)	28,812,522円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	25,074,355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)	48,116,712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)	64,679,011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)	2,580,679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)	39,164,844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)	79,335,907円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,770,318円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,357,660円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,645,651円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	84,131円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,629,549円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	19,406,561円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	329,150,489円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	444,067,749円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,333,443,233円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	11,539,890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)	17,410,915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)	172,513,613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)	29,685,188円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	58,117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)	199,085,447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)	11,553,816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)	43,572,616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)	98,966,968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)	146,668,277円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	19,164,165円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	12,880,270円
動的パッケージファンド<DC年金>	29,113,810円
コア資産形成ファンド	17,444,372円
MHAMトピックスファンド	787,490,722円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	45,243,310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]	1,905,921,914円
計	116,525,629,287円
2. 受益権の総数	116,525,629,287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9月17日 至 2023年9月19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9月19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9月19日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	83,452,781,507
合計	83,452,781,507

（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9月19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9月19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	14,266,015,000	-	14,547,375,000	281,360,000
合計	14,266,015,000	-	14,547,375,000	281,360,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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9月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.1954円 (41,954円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年9月19日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,300	4,065.00	29,674,500	
ニッセイ	192,400	763.80	146,955,120	
マルハニチロ	28,600	2,650.00	75,790,000	
雪国まいたけ	16,400	926.00	15,186,400	
カネコ種苗	5,900	1,522.00	8,979,800	
サカタのタネ	21,900	4,460.00	97,674,000	
ホクト	17,100	1,854.00	31,703,400	
ホクリヨウ	1,800	1,088.00	1,958,400	
ショーボンドホールディングス	26,200	5,920.00	155,104,000	
ミライト・ワン	63,700	2,056.00	130,967,200	
タマホーム	12,100	3,610.00	43,681,000	
サンヨーホームズ	1,600	729.00	1,166,400	
日本アクア	5,300	1,041.00	5,517,300	
ファーストコーポレーション	3,300	794.00	2,620,200	
ベステラ	2,700	983.00	2,654,100	
Robot Home	37,500	202.00	7,575,000	

キャンディル	2,400	623.00	1,495,200	
住石ホールディングス	19,900	455.00	9,054,500	
日鉄鉱業	7,700	5,580.00	42,966,000	
三井松島ホールディングス	8,800	2,950.00	25,960,000	
I N P E X	711,700	2,358.00	1,678,188,600	
石油資源開発	22,300	5,910.00	131,793,000	
K & O エナジーグループ	8,800	2,681.00	23,592,800	
ダイセキ環境ソリューション	2,600	1,262.00	3,281,200	
第一カッター興業	4,900	1,302.00	6,379,800	
明豊ファシリティワークス	4,700	743.00	3,492,100	
安藤・間	111,500	1,270.00	141,605,000	
東急建設	54,800	847.00	46,415,600	
コムシスホールディングス	61,500	3,265.00	200,797,500	
ビーアールホールディングス	30,600	385.00	11,781,000	
高松コンストラクショングループ	12,500	2,770.00	34,625,000	
東建コーポレーション	5,500	8,050.00	44,275,000	
ソネック	1,400	1,013.00	1,418,200	
ヤマウラ	9,800	1,269.00	12,436,200	
オリエンタル白石	69,000	337.00	23,253,000	
大成建設	126,000	5,360.00	675,360,000	
大林組	481,400	1,413.00	680,218,200	
清水建設	381,700	1,055.00	402,693,500	
飛島建設	14,800	1,433.00	21,208,400	
長谷工コーポレーション	139,000	1,974.00	274,386,000	
松井建設	12,500	795.00	9,937,500	
銭高組	1,100	4,035.00	4,438,500	
鹿島建設	298,500	2,596.00	774,906,000	
不動テトラ	9,300	2,054.00	19,102,200	
大末建設	3,200	1,559.00	4,988,800	
鉄建建設	9,700	2,247.00	21,795,900	
西松建設	22,900	3,898.00	89,264,200	
三井住友建設	108,500	427.00	46,329,500	
大豊建設	5,500	4,135.00	22,742,500	
佐田建設	5,700	509.00	2,901,300	
ナカノフドー建設	6,400	419.00	2,681,600	
奥村組	21,800	4,705.00	102,569,000	
東鉄工業	18,600	3,035.00	56,451,000	
イチケン	2,000	2,150.00	4,300,000	
富士ピー・エス	3,900	478.00	1,864,200	
浅沼組	10,700	3,705.00	39,643,500	
戸田建設	165,700	845.10	140,033,070	
熊谷組	22,500	3,495.00	78,637,500	
北野建設	1,700	3,045.00	5,176,500	
植木組	2,500	1,580.00	3,950,000	
矢作建設工業	18,300	1,366.00	24,997,800	
ピーエス三菱	17,100	875.00	14,962,500	
日本ハウスホールディングス	28,600	377.00	10,782,200	
大東建託	49,600	16,295.00	808,232,000	
新日本建設	18,900	1,271.00	24,021,900	
東亜道路工業	5,300	5,300.00	28,090,000	

日本道路	2,700	9,740.00	26,298,000
東亜建設工業	11,600	3,815.00	44,254,000
日本国土開発	38,200	667.00	25,479,400
若築建設	5,900	3,170.00	18,703,000
東洋建設	43,600	1,183.00	51,578,800
五洋建設	190,900	950.00	181,355,000
世紀東急工業	17,200	1,708.00	29,377,600
福田組	5,100	4,910.00	25,041,000
日本ドライケミカル	2,200	2,283.00	5,022,600
住友林業	116,300	4,270.00	496,601,000
日本基礎技術	5,400	513.00	2,770,200
巴コーポレーション	10,100	582.00	5,878,200
大和ハウス工業	372,200	4,201.00	1,563,612,200
ライト工業	24,900	2,072.00	51,592,800
積水ハウス	408,200	3,124.00	1,275,216,800
日特建設	12,800	1,149.00	14,707,200
北陸電気工事	9,300	1,062.00	9,876,600
ユアテック	29,500	1,016.00	29,972,000
日本リーテック	11,800	1,389.00	16,390,200
四電工	5,600	3,020.00	16,912,000
中電工	21,000	2,530.00	53,130,000
関電工	73,800	1,374.00	101,401,200
きんでん	94,800	2,244.00	212,731,200
東京エネシス	13,400	1,033.00	13,842,200
トーエネック	4,500	4,405.00	19,822,500
住友電設	12,800	2,904.00	37,171,200
日本電設工業	22,100	2,338.00	51,669,800
エクシオグループ	62,100	3,204.00	198,968,400
新日本空調	7,500	2,510.00	18,825,000
九電工	32,800	4,660.00	152,848,000
三機工業	29,800	1,661.00	49,497,800
日揮ホールディングス	133,200	2,250.50	299,766,600
中外炉工業	4,400	2,222.00	9,776,800
ヤマト	7,500	992.00	7,440,000
太平電業	8,300	4,085.00	33,905,500
高砂熱学工業	32,500	2,954.00	96,005,000
三晃金属工業	1,100	4,330.00	4,763,000
N E C ネットズエスアイ	46,000	1,997.00	91,862,000
朝日工業社	5,600	2,562.00	14,347,200
明星工業	23,200	1,062.00	24,638,400
大気社	15,500	4,810.00	74,555,000
ダイダン	8,900	3,090.00	27,501,000
日比谷総合設備	11,100	2,359.00	26,184,900
ニッポン	36,400	2,180.00	79,352,000
日清製粉グループ本社	125,000	1,965.50	245,687,500
日東富士製粉	2,300	5,000.00	11,500,000
昭和産業	11,800	3,125.00	36,875,000
鳥越製粉	8,000	687.00	5,496,000
中部飼料	18,800	1,168.00	21,958,400
フィード・ワン	19,800	827.00	16,374,600

東洋精糖	1,700	2,233.00	3,796,100	
日本甜菜製糖	7,900	1,955.00	15,444,500	
D M三井製糖ホールディングス	13,500	3,125.00	42,187,500	
塩水港精糖	11,000	266.00	2,926,000	
ウェルネオシュガー	7,000	2,124.00	14,868,000	
L I F U L L	48,200	236.00	11,375,200	
M I X I	32,100	2,430.00	78,003,000	
ジェイエイシーリクルートメント	12,700	2,491.00	31,635,700	
日本M&Aセンターホールディングス	242,100	767.50	185,811,750	
メンバーズ	4,200	1,235.00	5,187,000	
中広	1,000	445.00	445,000	
U Tグループ	20,800	2,266.00	47,132,800	
アイティメディア	5,300	1,205.00	6,386,500	
E・Jホールディングス	8,200	1,774.00	14,546,800	
オープンアップグループ	42,300	1,880.00	79,524,000	
コシダカホールディングス	42,300	1,260.00	53,298,000	
アルトナー	2,300	1,811.00	4,165,300	
パソナグループ	17,100	1,683.00	28,779,300	
C D S	2,400	1,753.00	4,207,200	
リンクアンドモチベーション	40,600	461.00	18,716,600	
エス・エム・エス	53,600	2,574.50	137,993,200	
サニーサイドアップグループ	2,800	817.00	2,287,600	
パーソルホールディングス	155,600	2,504.00	389,622,400	
リニカル	5,300	704.00	3,731,200	
クックパッド	38,600	151.00	5,828,600	
エスクリ	3,800	338.00	1,284,400	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,600	700.00	3,220,000	
森永製菓	24,100	5,382.00	129,706,200	
中村屋	3,300	3,130.00	10,329,000	
江崎グリコ	38,600	4,089.00	157,835,400	
名糖産業	5,300	1,670.00	8,851,000	
井村屋グループ	7,400	2,325.00	17,205,000	
不二家	9,300	2,525.00	23,482,500	
山崎製パン	90,500	2,852.50	258,151,250	
第一屋製パン	1,800	438.00	788,400	
モロゾフ	4,400	3,715.00	16,346,000	
亀田製菓	8,600	4,350.00	37,410,000	
寿スピリッツ	14,400	11,740.00	169,056,000	
カルビー	61,900	2,979.00	184,400,100	
森永乳業	24,500	5,861.00	143,594,500	
六甲バター	9,900	1,389.00	13,751,100	
ヤクルト本社	96,500	7,581.00	731,566,500	
明治ホールディングス	165,700	3,737.00	619,220,900	
雪印メグミルク	32,700	2,329.00	76,158,300	
プリマハム	18,200	2,520.00	45,864,000	
日本ハム	52,800	4,595.00	242,616,000	
林兼産業	2,800	557.00	1,559,600	
丸大食品	13,700	1,703.00	23,331,100	
S F o o d s	14,900	3,435.00	51,181,500	
柿安本店	5,200	2,497.00	12,984,400	

伊藤ハム米久ホールディングス	103,200	820.00	84,624,000	
学情	7,200	1,972.00	14,198,400	
スタジオアリス	7,000	2,093.00	14,651,000	
クロスキャット	7,800	1,015.00	7,917,000	
シミックホールディングス	6,800	1,782.00	12,117,600	
エブコ	2,600	748.00	1,944,800	
システナ	231,500	278.00	64,357,000	
N J S	3,100	3,000.00	9,300,000	
デジタルアーツ	8,700	4,735.00	41,194,500	
日鉄ソリューションズ	23,500	4,290.00	100,815,000	
総合警備保障	261,900	924.70	242,178,930	
キューブシステム	8,100	1,202.00	9,736,200	
いちご	155,700	327.00	50,913,900	
日本駐車場開発	143,000	210.00	30,030,000	
コア	6,200	1,780.00	11,036,000	
カカクコム	103,500	1,621.50	167,825,250	
アイロムグループ	5,100	1,906.00	9,720,600	
セントケア・ホールディング	9,000	830.00	7,470,000	
サイネックス	1,600	697.00	1,115,200	
ルネサンス	9,900	930.00	9,207,000	
ディップ	24,700	3,725.00	92,007,500	
S B Sホールディングス	12,200	2,864.00	34,940,800	
デジタルホールディングス	7,300	1,049.00	7,657,700	
新日本科学	14,900	1,865.00	27,788,500	
キャリアデザインセンター	2,000	2,080.00	4,160,000	
ベネフィット・ワン	65,300	1,131.00	73,854,300	
エムスリー	278,800	2,814.50	784,682,600	
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	435.00	2,653,500	
プラス	1,000	718.00	718,000	
アウトソーシング	90,600	1,182.50	107,134,500	
ウェルネット	7,200	578.00	4,161,600	
ワールドホールディングス	6,400	2,424.00	15,513,600	
ディー・エヌ・エー	56,500	1,541.00	87,066,500	
博報堂D Yホールディングス	180,000	1,315.00	236,700,000	
ぐるなび	25,900	331.00	8,572,900	
タカミヤ	19,100	523.00	9,989,300	
ジャパンベストレスキューシステム	7,000	735.00	5,145,000	
ファンコミュニケーションズ	19,800	402.00	7,959,600	
ライク	5,200	1,554.00	8,080,800	
ビジネス・ブレークスルー	3,500	399.00	1,396,500	
エスプール	40,600	467.00	18,960,200	
W D Bホールディングス	7,200	2,111.00	15,199,200	
手間いらず	2,300	2,841.00	6,534,300	
ティア	5,500	470.00	2,585,000	
C D G	1,000	1,320.00	1,320,000	
アドウェイズ	19,400	557.00	10,805,800	
バリューコマース	12,400	1,259.00	15,611,600	
インフォマート	146,500	473.00	69,294,500	
サッポロホールディングス	44,500	4,716.00	209,862,000	
アサヒグループホールディングス	312,300	5,927.00	1,851,002,100	



キリンホールディングス	563,000	2,137.00	1,203,131,000	
宝ホールディングス	92,100	1,257.00	115,769,700	
オエノンホールディングス	40,300	451.00	18,175,300	
養命酒製造	4,500	1,913.00	8,608,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	105,900	2,067.00	218,895,300	
ライフドリンク カンパニー	2,500	3,895.00	9,737,500	
サントリー食品インターナショナル	95,200	4,708.00	448,201,600	
ダイドグループホールディングス	7,600	5,760.00	43,776,000	
伊藤園	45,800	4,906.00	224,694,800	
キーコーヒー	15,100	2,033.00	30,698,300	
ユニカフェ	3,000	954.00	2,862,000	
ジャパンフーズ	1,500	1,122.00	1,683,000	
日清オイリオグループ	19,000	4,375.00	83,125,000	
不二製油グループ本社	31,500	2,330.00	73,395,000	
かどや製油	1,100	3,520.00	3,872,000	
J・オイルミルズ	13,800	1,843.00	25,433,400	
ローソン	36,000	6,803.00	244,908,000	
サンエー	11,100	4,890.00	54,279,000	
カワチ薬品	11,400	2,328.00	26,539,200	
エービーシー・マート	63,600	2,758.00	175,408,800	
ハードオフコーポレーション	3,900	1,526.00	5,951,400	
高千穂交易	3,400	3,315.00	11,271,000	
アスクル	30,100	1,893.00	56,979,300	
ゲオホールディングス	14,200	2,507.00	35,599,400	
アダストリア	17,500	2,878.00	50,365,000	
ジーフット	6,700	288.00	1,929,600	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,300	864.00	1,123,200	
オルパヘルスケアホールディングス	1,500	1,775.00	2,662,500	
伊藤忠食品	3,200	6,620.00	21,184,000	
くら寿司	17,000	3,465.00	58,905,000	
キャンドウ	5,100	2,733.00	13,938,300	
エレマテック	13,000	1,935.00	25,155,000	
IKホールディングス	3,000	391.00	1,173,000	
パルグループホールディングス	28,600	2,013.00	57,571,800	
エディオン	57,500	1,500.00	86,250,000	
あらた	11,100	5,860.00	65,046,000	
サーラコーポレーション	30,500	779.00	23,759,500	
ワッツ	4,700	608.00	2,857,600	
トーメンデバイス	2,100	5,080.00	10,668,000	
ハローズ	6,600	4,255.00	28,083,000	
J Pホールディングス	40,600	338.00	13,722,800	
フジオフードグループ本社	16,300	1,405.00	22,901,500	
あみやき亭	3,500	3,645.00	12,757,500	
東京エレクトロン デバイス	5,300	10,450.00	55,385,000	
ひらまつ	20,800	272.00	5,657,600	
円谷フィールズホールディングス	24,900	2,106.00	52,439,400	
双日	144,700	3,522.00	509,633,400	
アルフレッサ ホールディングス	145,800	2,601.50	379,298,700	
大黒天物産	4,500	6,760.00	30,420,000	

ハニーズホールディングス	11,500	1,651.00	18,986,500	
ファーマライズホールディングス	2,200	654.00	1,438,800	
キッコーマン	89,500	8,460.00	757,170,000	
味の素	326,300	5,850.00	1,908,855,000	
ブルドックソース	7,100	2,100.00	14,910,000	
キュービー	72,600	2,463.50	178,850,100	
ハウス食品グループ本社	41,300	3,166.00	130,755,800	
カゴメ	58,100	3,318.00	192,775,800	
焼津水産化学工業	3,500	1,243.00	4,350,500	
アリアケジャパン	11,800	5,090.00	60,062,000	
ピエトロ	1,400	1,865.00	2,611,000	
エバラ食品工業	3,700	3,040.00	11,248,000	
やまみ	800	1,947.00	1,557,600	
ニチレイ	61,900	3,560.00	220,364,000	
横浜冷凍	39,600	1,354.00	53,618,400	
東洋水産	68,200	5,947.00	405,585,400	
イトアンドホールディングス	5,900	2,130.00	12,567,000	
大冷	1,100	2,044.00	2,248,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,600	1,318.00	11,334,800	
日清食品ホールディングス	47,500	12,475.00	592,562,500	
永谷園ホールディングス	6,700	2,324.00	15,570,800	
一正蒲鉾	4,000	782.00	3,128,000	
フジッコ	13,900	1,960.00	27,244,000	
ロック・フィールド	15,100	1,636.00	24,703,600	
日本たばこ産業	821,300	3,384.00	2,779,279,200	
ケンコーマヨネーズ	9,300	1,459.00	13,568,700	
わらべや日洋ホールディングス	9,900	2,917.00	28,878,300	
なとり	8,600	1,998.00	17,182,800	
イフジ産業	1,600	1,616.00	2,585,600	
ファーマフーズ	19,400	1,555.00	30,167,000	
北の達人コーポレーション	57,900	246.00	14,243,400	
ユーグレナ	84,100	810.00	68,121,000	
紀文食品	10,500	1,218.00	12,789,000	
ピックルスホールディングス	7,900	1,284.00	10,143,600	
スター・マイカ・ホールディングス	15,800	657.00	10,380,600	
SREホールディングス	6,700	3,155.00	21,138,500	
ADワークスグループ	23,000	256.00	5,888,000	
片倉工業	12,600	1,812.00	22,831,200	
グンゼ	9,800	4,645.00	45,521,000	
ヒューリック	315,400	1,388.50	437,932,900	
神栄	1,300	1,647.00	2,141,100	
ラサ商事	4,500	1,628.00	7,326,000	
アルペン	12,000	1,932.00	23,184,000	
ハブ	3,100	849.00	2,631,900	
ラクーンホールディングス	11,400	743.00	8,470,200	
クオールホールディングス	19,900	1,928.00	38,367,200	
アルコニックス	19,100	1,414.00	27,007,400	
神戸物産	112,400	3,648.00	410,035,200	
ソリトンシステムズ	7,100	1,159.00	8,228,900	
ジンズホールディングス	8,700	3,165.00	27,535,500	

ビックカメラ	77,300	1,087.00	84,025,100
DCMホールディングス	84,400	1,248.00	105,331,200
ペッパーフードサービス	30,200	115.00	3,473,000
ハイパー	2,100	358.00	751,800
MonotaRO	205,900	1,591.00	327,586,900
東京一番フーズ	2,400	555.00	1,332,000
DDグループ	6,300	1,770.00	11,151,000
あいホールディングス	23,300	2,461.00	57,341,300
ディーブイエックス	2,700	1,022.00	2,759,400
きちりホールディングス	2,300	885.00	2,035,500
J.フロントリテイリング	180,500	1,584.00	285,912,000
ドトール・日レスホールディングス	25,800	2,366.00	61,042,800
マツキヨココカラ&カンパニー	88,100	8,249.00	726,736,900
ブロンコビリー	8,600	3,035.00	26,101,000
ZOZO	96,000	2,896.00	278,016,000
トレジャー・ファクトリー	5,900	1,334.00	7,870,600
物語コーポレーション	24,200	4,355.00	105,391,000
三越伊勢丹ホールディングス	244,500	1,731.00	423,229,500
東洋紡	59,400	1,118.50	66,438,900
ユニチカ	41,400	213.00	8,818,200
富士紡ホールディングス	5,400	3,765.00	20,331,000
日清紡ホールディングス	104,300	1,103.50	115,095,050
倉敷紡績	10,200	2,572.00	26,234,400
ダイワボウホールディングス	59,400	2,990.50	177,635,700
シキボウ	4,900	1,112.00	5,448,800
日東紡績	15,400	3,575.00	55,055,000
トヨタ紡織	57,800	2,905.50	167,937,900
マクニカホールディングス	34,300	6,570.00	225,351,000
Hamee	5,000	925.00	4,625,000
マーケットエンタープライズ	900	1,228.00	1,105,200
ラクト・ジャパン	5,600	2,163.00	12,112,800
ウエルシアホールディングス	75,300	2,649.00	199,469,700
クリエイトSDホールディングス	24,000	3,515.00	84,360,000
グリムス	6,100	2,264.00	13,810,400
パイタルケーエスケー・ホールディングス	18,100	1,005.00	18,190,500
八洲電機	11,800	1,313.00	15,493,400
メディアスホールディングス	9,300	777.00	7,226,100
レスターホールディングス	13,900	2,528.00	35,139,200
ジオリーブグループ	2,300	1,274.00	2,930,200
丸善CHIホールディングス	11,500	345.00	3,967,500
大光	4,100	673.00	2,759,300
OCHIホールディングス	2,200	1,457.00	3,205,400
TOKAIホールディングス	71,600	941.00	67,375,600
黒谷	2,700	609.00	1,644,300
ミサワ	1,800	610.00	1,098,000
ティーライフ	1,300	1,409.00	1,831,700
Cominix	1,900	883.00	1,677,700
エー・ピーホールディングス	2,000	1,019.00	2,038,000
三洋貿易	16,400	1,419.00	23,271,600

チムニー	3,000	1,516.00	4,548,000
シュッピン	10,900	1,117.00	12,175,300
ビューティガレージ	2,300	5,300.00	12,190,000
オイシックス・ラ・大地	19,500	1,662.00	32,409,000
ウイン・パートナーズ	10,500	1,122.00	11,781,000
ネクステージ	33,200	2,102.00	69,786,400
ジョイフル本田	42,300	1,759.00	74,405,700
鳥貴族ホールディングス	5,300	3,340.00	17,702,000
ホットランド	11,200	1,687.00	18,894,400
すかいらくホールディングス	198,500	2,042.50	405,436,250
SFPホールディングス	7,900	2,271.00	17,940,900
綿半ホールディングス	11,300	1,374.00	15,526,200
日本毛織	36,200	1,375.00	49,775,000
ダイトウボウ	14,400	95.00	1,368,000
トーア紡コーポレーション	3,500	462.00	1,617,000
ダイドーリミテッド	13,100	312.00	4,087,200
ヨシックスホールディングス	1,900	2,808.00	5,335,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	47,300	1,118.00	52,881,400
三栄建築設計	6,600	2,022.00	13,345,200
野村不動産ホールディングス	84,500	3,961.00	334,704,500
三重交通グループホールディングス	28,800	610.00	17,568,000
サムティ	21,500	2,418.00	51,987,000
ディア・ライフ	23,100	890.00	20,559,000
コーセーアールイー	2,800	967.00	2,707,600
地主	10,300	1,925.00	19,827,500
プレサンスコーポレーション	21,400	1,980.00	42,372,000
フィル・カンパニー	2,100	730.00	1,533,000
THEグローバル社	5,200	411.00	2,137,200
ハウスコム	1,500	938.00	1,407,000
JPMC	7,800	1,166.00	9,094,800
サンセイランディック	2,600	1,071.00	2,784,600
エストラスト	1,100	649.00	713,900
フージャースホールディングス	20,900	1,176.00	24,578,400
オープンハウスグループ	49,500	5,231.00	258,934,500
東急不動産ホールディングス	406,500	981.90	399,142,350
飯田グループホールディングス	115,100	2,656.00	305,705,600
イーランド	1,400	1,603.00	2,244,200
ムゲンエステート	6,100	1,118.00	6,819,800
帝国繊維	15,400	1,968.00	30,307,200
日本コークス工業	124,200	129.00	16,021,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,600	726.00	4,791,600
ミタチ産業	2,500	1,160.00	2,900,000
B E E N O S	6,200	1,600.00	9,920,000
あさひ	12,100	1,292.00	15,633,200
日本調剤	9,800	1,506.00	14,758,800
コスモス薬品	14,400	15,790.00	227,376,000
シップヘルスケアホールディングス	52,200	2,347.00	122,513,400
トーエル	4,300	770.00	3,311,000
ソフトクリエイイトホールディングス	11,300	1,708.00	19,300,400

セブン&アイ・ホールディングス	500,500	6,071.00	3,038,535,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	109,300	1,167.00	127,553,100	
明治電機工業	5,400	1,530.00	8,262,000	
ツルハホールディングス	30,500	10,365.00	316,132,500	
デリカフーズホールディングス	3,800	680.00	2,584,000	
スターティアホールディングス	1,900	1,698.00	3,226,200	
サンマルクホールディングス	11,700	1,908.00	22,323,600	
フェリシモ	2,200	1,008.00	2,217,600	
トリドールホールディングス	36,100	3,825.00	138,082,500	
帝人	132,000	1,612.00	212,784,000	
東レ	921,200	837.50	771,505,000	
クラレ	200,400	1,736.00	347,894,400	
旭化成	858,600	1,002.50	860,746,500	
T O K Y O B A S E	14,900	338.00	5,036,200	
稲葉製作所	7,400	1,579.00	11,684,600	
宮地エンジニアリンググループ	3,900	6,280.00	24,492,000	
トーカロ	37,700	1,433.00	54,024,100	
アルファ	3,400	1,585.00	5,389,000	
S U M C O	251,600	1,984.50	499,300,200	
川田テクノロジーズ	3,300	6,310.00	20,823,000	
R S T e c h n o l o g i e s	9,500	2,486.00	23,617,000	
ジェイテックコーポレーション	1,300	2,697.00	3,506,100	
信和	5,200	800.00	4,160,000	
ビーロット	6,300	886.00	5,581,800	
ファーストブラザーズ	1,900	1,213.00	2,304,700	
A n d D o ホールディングス	8,000	1,032.00	8,256,000	
シーアールイー	7,500	1,556.00	11,670,000	
プロパティエージェント	1,100	1,465.00	1,611,500	
ケイアイスター不動産	6,500	4,895.00	31,817,500	
アグレ都市デザイン	1,600	1,573.00	2,516,800	
グッドコムアセット	12,500	973.00	12,162,500	
ジェイ・エス・ビー	3,300	5,610.00	18,513,000	
ロードスターキャピタル	8,800	1,856.00	16,332,800	
テンポイノベーション	2,700	1,227.00	3,312,900	
グローバル・リンク・マネジメント	1,800	2,063.00	3,713,400	
フェイスネットワーク	2,400	1,467.00	3,520,800	
住江織物	1,900	2,312.00	4,392,800	
日本フェルト	5,100	440.00	2,244,000	
イチカワ	1,100	1,546.00	1,700,600	
エコナックホールディングス	16,300	83.00	1,352,900	
日東製網	900	1,535.00	1,381,500	
芦森工業	1,700	2,258.00	3,838,600	
アツギ	5,400	449.00	2,424,600	
ウイルプラスホールディングス	1,600	1,226.00	1,961,600	
J Mホールディングス	11,000	1,954.00	21,494,000	
コメダホールディングス	35,600	2,969.00	105,696,400	
サツドラホールディングス	4,400	819.00	3,603,600	
アレンザホールディングス	10,900	1,008.00	10,987,200	
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,630.00	6,357,000	

パロックジャパンリミテッド	9,400	851.00	7,999,400	
クスリのアオキホールディングス	12,900	8,814.00	113,700,600	
ダイニック	2,300	827.00	1,902,100	
共和レザー	5,300	677.00	3,588,100	
ピーバンドットコム	1,400	455.00	637,000	
力の源ホールディングス	5,500	2,234.00	12,287,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	77,400	2,663.00	206,116,200	
アセンテック	4,900	539.00	2,641,100	
セーレン	26,500	2,362.00	62,593,000	
ソトー	2,900	788.00	2,285,200	
東海染工	900	1,095.00	985,500	
小松マテーレ	19,900	771.00	15,342,900	
ワコールホールディングス	25,000	3,310.00	82,750,000	
ホギメディカル	18,500	3,255.00	60,217,500	
クラウドシアホールディングス	2,100	554.00	1,163,400	
T S Iホールディングス	46,300	825.00	38,197,500	
マツオカコーポレーション	2,500	1,627.00	4,067,500	
ワールド	17,600	1,713.00	30,148,800	
T I S	150,600	3,453.00	520,021,800	
J N Sホールディングス	4,200	443.00	1,860,600	
グリー	36,800	586.00	21,564,800	
G M Oペパボ	1,700	1,360.00	2,312,000	
コーエーテクモホールディングス	86,300	2,226.50	192,146,950	
三菱総合研究所	6,800	5,070.00	34,476,000	
ポルテージ	2,600	288.00	748,800	
電算	900	1,589.00	1,430,100	
A G S	3,800	740.00	2,812,000	
ファインデックス	11,000	736.00	8,096,000	
ブレインパッド	10,300	879.00	9,053,700	
K L a b	25,400	282.00	7,162,800	
ポルトウウィンホールディングス	23,500	573.00	13,465,500	
ネクソン	306,900	2,916.00	894,920,400	
アイスタイル	40,800	488.00	19,910,400	
エムアップホールディングス	16,900	1,224.00	20,685,600	
エイチーム	8,100	607.00	4,916,700	
エニグモ	17,500	381.00	6,667,500	
テクノスジャパン	7,500	720.00	5,400,000	
e n i s h	7,400	232.00	1,716,800	
コロブラ	53,300	661.00	35,231,300	
オルトプラス	7,700	217.00	1,670,900	
ブロードリーフ	65,300	510.00	33,303,000	
クロス・マーケティンググループ	5,500	722.00	3,971,000	
デジタルハーツホールディングス	8,600	1,068.00	9,184,800	
システム情報	11,000	760.00	8,360,000	
メディアドゥ	5,400	1,168.00	6,307,200	
じげん	40,100	556.00	22,295,600	
ブイキューブ	16,500	408.00	6,732,000	
エンカレッジ・テクノロジー	2,200	513.00	1,128,600	
サイバーリンクス	3,500	807.00	2,824,500	

ディー・エル・イー	6,500	253.00	1,644,500	
フィックスターズ	15,500	1,200.00	18,600,000	
CARTA HOLDINGS	6,500	1,262.00	8,203,000	
オブティム	11,300	853.00	9,638,900	
セレス	5,500	969.00	5,329,500	
SHIFT	9,200	27,025.00	248,630,000	
特種東海製紙	6,200	3,550.00	22,010,000	
ティーガイア	14,400	1,817.00	26,164,800	
セック	1,300	3,490.00	4,537,000	
テクマトリックス	25,100	1,562.00	39,206,200	
プロシップ	6,100	1,288.00	7,856,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	35,800	2,387.00	85,454,600	
GMOペイメントゲートウェイ	27,600	8,427.00	232,585,200	
ザッパラス	2,600	477.00	1,240,200	
システムリサーチ	4,300	2,696.00	11,592,800	
インターネットイニシアティブ	75,200	2,444.50	183,826,400	
さくらインターネット	15,400	1,309.00	20,158,600	
ヴィンクス	2,200	1,303.00	2,866,600	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,200	2,791.00	11,722,200	
SRAホールディングス	7,100	3,635.00	25,808,500	
システムインテグレータ	2,700	428.00	1,155,600	
朝日ネット	14,700	639.00	9,393,300	
eBASE	19,400	681.00	13,211,400	
アバントグループ	17,400	1,322.00	23,002,800	
アドソル日進	5,800	1,748.00	10,138,400	
ODKソリューションズ	2,000	604.00	1,208,000	
フリービット	7,200	1,251.00	9,007,200	
コムチュア	18,200	2,428.00	44,189,600	
サイバーコム	1,500	1,343.00	2,014,500	
アステリア	10,700	754.00	8,067,800	
アイル	6,500	3,655.00	23,757,500	
王子ホールディングス	572,600	677.60	387,993,760	
日本製紙	71,600	1,424.00	101,958,400	
三菱製紙	11,100	578.00	6,415,800	
北越コーポレーション	86,900	1,073.00	93,243,700	
中越パルプ工業	3,800	1,517.00	5,764,600	
巴川製紙所	2,900	681.00	1,974,900	
大王製紙	60,700	1,309.50	79,486,650	
阿波製紙	2,200	527.00	1,159,400	
マークライNZ	7,400	3,045.00	22,533,000	
メディカル・データ・ビジョン	16,500	809.00	13,348,500	
gumi	20,200	523.00	10,564,600	
ショーケース	2,100	372.00	781,200	
モバイルファクトリー	1,900	803.00	1,525,700	
テラスカイ	5,900	2,021.00	11,923,900	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,900	1,810.00	14,299,000	
PCIホールディングス	3,500	1,100.00	3,850,000	

アイビーシー	1,400	605.00	847,000
ネオジャパン	4,600	1,020.00	4,692,000
PR TIMES	3,400	1,790.00	6,086,000
ラクス	65,100	2,203.50	143,447,850
ランドコンピュータ	2,300	1,228.00	2,824,400
ダブルスタンダード	5,500	1,421.00	7,815,500
オープンドア	9,600	1,022.00	9,811,200
マイネット	3,000	355.00	1,065,000
アカツキ	6,600	2,317.00	15,292,200
ベネフィットジャパン	500	1,224.00	612,000
Ubicomホールディングス	4,300	1,297.00	5,577,100
カナミックネットワーク	14,800	507.00	7,503,600
ノムラシステムコーポレーション	9,900	117.00	1,158,300
レンゴー	125,100	1,055.50	132,043,050
トーモク	7,900	2,536.00	20,034,400
ザ・パック	10,200	3,285.00	33,507,000
チェンジホールディングス	33,700	1,898.00	63,962,600
シンクロ・フード	5,800	614.00	3,561,200
オークネット	5,400	1,806.00	9,752,400
キャピタル・アセット・プランニング	1,800	888.00	1,598,400
セグエグループ	2,900	959.00	2,781,100
エイトレッド	1,400	1,473.00	2,062,200
マクロミル	27,000	779.00	21,033,000
ビーグリー	1,900	1,111.00	2,110,900
オロ	5,000	1,926.00	9,630,000
ユーザーローカル	5,000	1,841.00	9,205,000
テモナ	2,100	299.00	627,900
ニーズウェル	5,000	714.00	3,570,000
マネーフォワード	30,600	5,138.00	157,222,800
サインポスト	3,500	483.00	1,690,500
レゾナック・ホールディングス	132,800	2,548.50	338,440,800
住友化学	1,019,800	434.00	442,593,200
住友精化	5,700	4,810.00	27,417,000
日産化学	64,900	6,686.00	433,921,400
ラサ工業	5,300	2,120.00	11,236,000
クレハ	11,100	8,710.00	96,681,000
多木化学	5,300	3,805.00	20,166,500
テイカ	9,300	1,410.00	13,113,000
石原産業	24,800	1,561.00	38,712,800
片倉コープアグリ	1,900	1,202.00	2,283,800
日本曹達	14,700	5,760.00	84,672,000
東ソー	183,600	2,028.00	372,340,800
トクヤマ	44,400	2,494.50	110,755,800
セントラル硝子	22,100	3,125.00	69,062,500
東亜合成	69,000	1,388.00	95,772,000
大阪ソーダ	8,200	6,560.00	53,792,000
関東電化工業	26,600	912.00	24,259,200
SUN ASTERISK	9,800	1,422.00	13,935,600
デンカ	50,000	2,893.00	144,650,000
イビデン	79,500	8,040.00	639,180,000



信越化学工業	1,142,900	4,647.00	5,311,056,300	
日本カーバイド工業	3,400	1,784.00	6,065,600	
プラスアルファ・コンサルティング	7,900	2,771.00	21,890,900	
電算システムホールディングス	6,100	3,010.00	18,361,000	
堺化学工業	10,400	2,148.00	22,339,200	
第一稀元素化学工業	12,500	980.00	12,250,000	
エア・ウォーター	129,700	1,905.50	247,143,350	
日本酸素ホールディングス	133,400	3,608.00	481,307,200	
日本化学工業	4,600	1,995.00	9,177,000	
東邦アセチレン	1,900	1,634.00	3,104,600	
日本パーカライジング	68,000	1,184.00	80,512,000	
高压ガス工業	20,000	789.00	15,780,000	
チタン工業	1,100	1,413.00	1,554,300	
四国化成ホールディングス	17,700	1,527.00	27,027,900	
戸田工業	3,100	2,023.00	6,271,300	
ステラ ケミファ	8,100	3,220.00	26,082,000	
保土谷化学工業	3,900	3,270.00	12,753,000	
日本触媒	21,000	5,670.00	119,070,000	
大日精化工業	9,600	2,411.00	23,145,600	
カネカ	31,400	4,222.00	132,570,800	
協和キリン	166,300	2,702.00	449,342,600	
A P P I E R G R O U P	47,000	1,705.00	80,135,000	
三菱瓦斯化学	102,700	2,150.00	220,805,000	
三井化学	113,300	3,959.00	448,554,700	
J S R	128,400	4,048.00	519,763,200	
東京応化工業	21,900	9,173.00	200,888,700	
大阪有機化学工業	11,500	2,567.00	29,520,500	
三菱ケミカルグループ	927,800	980.80	909,986,240	
K H ネオケム	21,000	2,403.00	50,463,000	
ダイセル	191,500	1,322.50	253,258,750	
住友ベークライト	20,300	6,526.00	132,477,800	
積水化学工業	278,700	2,271.50	633,067,050	
日本ゼオン	82,400	1,723.50	142,016,400	
アイカ工業	34,800	3,455.00	120,234,000	
U B E	70,900	2,694.50	191,040,050	
積水樹脂	19,100	2,369.00	45,247,900	
タキロンシーアイ	30,000	589.00	17,670,000	
旭有機材	9,200	3,845.00	35,374,000	
ニチバン	8,600	1,918.00	16,494,800	
リケンテクノス	29,600	758.00	22,436,800	
大倉工業	6,400	2,638.00	16,883,200	
積水化成品工業	19,200	488.00	9,369,600	
群栄化学工業	3,200	3,490.00	11,168,000	
タイガースポリマー	4,200	775.00	3,255,000	
ミライアル	2,800	1,397.00	3,911,600	
ダイキアクシス	3,900	737.00	2,874,300	
ダイキョーニシカワ	30,400	865.00	26,296,000	
竹本容器	3,400	815.00	2,771,000	
森六ホールディングス	7,000	2,408.00	16,856,000	
恵和	9,900	1,299.00	12,860,100	

日本化薬	105,100	1,308.50	137,523,350
カーリットホールディングス	12,400	997.00	12,362,800
ソルクシーズ	7,400	425.00	3,145,000
CLホールディングス	3,300	833.00	2,748,900
プレステージ・インターナショナル	59,400	632.00	37,540,800
フェイス	2,600	501.00	1,302,600
プロトコーポレーション	17,200	1,223.00	21,035,600
ハイマックス	4,300	1,453.00	6,247,900
アミューズ	7,600	1,621.00	12,319,600
野村総合研究所	274,200	4,274.00	1,171,930,800
ドリームインキュベータ	4,300	3,020.00	12,986,000
サイバネットシステム	9,900	762.00	7,543,800
クイック	10,700	2,142.00	22,919,400
TAC	4,900	201.00	984,900
CEホールディングス	4,800	585.00	2,808,000
日本システム技術	3,900	2,233.00	8,708,700
電通グループ	138,700	4,418.00	612,776,600
インテージホールディングス	15,500	2,195.00	34,022,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	1,000.00	3,700,000
東邦システムサイエンス	3,900	1,388.00	5,413,200
ぴあ	4,700	3,875.00	18,212,500
イオンファンタジー	6,100	3,180.00	19,398,000
ソースネクスト	70,000	192.00	13,440,000
シーティーエス	15,500	698.00	10,819,000
ネクシィーズグループ	2,900	815.00	2,363,500
インフォコム	17,700	2,872.00	50,834,400
メディカルシステムネットワーク	12,500	403.00	5,037,500
日本精化	7,800	2,594.00	20,233,200
扶桑化学工業	12,700	3,990.00	50,673,000
トリケミカル研究所	18,400	3,070.00	56,488,000
シンプレクス・ホールディングス	23,600	2,748.00	64,852,800
HEROZ	4,600	1,522.00	7,001,200
ラクスル	33,000	1,398.00	46,134,000
メルカリ	83,300	3,186.00	265,393,800
IPS	4,500	2,479.00	11,155,500
FIG	10,500	307.00	3,223,500
システムサポート	5,300	2,169.00	11,495,700
ADEKA	47,900	2,786.00	133,449,400
日油	42,500	6,577.00	279,522,500
ミヨシ油脂	3,500	1,195.00	4,182,500
新日本理化	12,600	233.00	2,935,800
ハリマ化成グループ	6,400	867.00	5,548,800
イーソル	9,900	756.00	7,484,400
東海ソフト	1,400	1,093.00	1,530,200
ウイングアーク1st	14,200	2,614.00	37,118,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,700	1,400.00	5,180,000
サーバーワークス	2,800	3,740.00	10,472,000
東名	700	2,419.00	1,693,300
ヴィッツ	900	1,153.00	1,037,700

トピラシステムズ	2,600	970.00	2,522,000	
Sansan	45,100	1,331.50	60,050,650	
Link-U	2,200	862.00	1,896,400	
ギフトィ	12,000	1,463.00	17,556,000	
花王	310,900	5,623.00	1,748,190,700	
第一工業製薬	4,900	1,755.00	8,599,500	
石原ケミカル	6,300	1,711.00	10,779,300	
日華化学	3,700	905.00	3,348,500	
ニイタカ	1,700	2,005.00	3,408,500	
三洋化成工業	8,500	4,200.00	35,700,000	
メドレー	18,500	4,950.00	91,575,000	
ベース	4,700	4,515.00	21,220,500	
JMDC	22,600	5,480.00	123,848,000	
武田薬品工業	1,218,400	4,829.00	5,883,653,600	
アステラス製薬	1,300,500	2,198.00	2,858,499,000	
住友ファーマ	102,100	552.50	56,410,250	
塩野義製薬	173,500	6,744.00	1,170,084,000	
わかもと製薬	8,500	229.00	1,946,500	
日本新薬	32,500	6,647.00	216,027,500	
中外製薬	431,000	4,458.00	1,921,398,000	
科研製薬	23,600	3,616.00	85,337,600	
エーザイ	167,500	8,934.00	1,496,445,000	
理研ビタミン	11,700	2,328.00	27,237,600	
ロート製薬	133,400	4,093.00	546,006,200	
小野薬品工業	265,600	2,926.50	777,278,400	
久光製薬	30,600	5,332.00	163,159,200	
有機合成薬品工業	6,600	298.00	1,966,800	
持田製薬	15,900	3,435.00	54,616,500	
参天製薬	250,900	1,431.00	359,037,900	
扶桑薬品工業	4,400	2,041.00	8,980,400	
日本ケミファ	900	1,920.00	1,728,000	
ツムラ	43,300	2,783.00	120,503,900	
テルモ	422,100	4,325.00	1,825,582,500	
H.U.グループホールディングス	41,300	2,640.00	109,032,000	
キッセイ薬品工業	20,200	3,460.00	69,892,000	
生化学工業	26,300	832.00	21,881,600	
栄研化学	22,300	1,426.00	31,799,800	
鳥居薬品	7,400	3,860.00	28,564,000	
JCRファーマ	46,600	1,452.00	67,663,200	
東和薬品	21,200	2,894.00	61,352,800	
富士製薬工業	10,200	1,219.00	12,433,800	
ゼリア新薬工業	19,100	2,372.00	45,305,200	
そーせいグループ	44,400	1,606.00	71,306,400	
第一三共	1,199,300	4,055.00	4,863,161,500	
杏林製薬	29,800	1,834.00	54,653,200	
大幸薬品	27,200	355.00	9,656,000	
ダイト	10,500	2,424.00	25,452,000	
大塚ホールディングス	286,400	5,570.00	1,595,248,000	
大正製薬ホールディングス	30,600	6,233.00	190,729,800	
ペプチドリーム	66,700	1,657.00	110,521,900	

大日本塗料	16,800	1,001.00	16,816,800
日本ペイントホールディングス	730,100	1,116.50	815,156,650
関西ペイント	110,200	2,218.00	244,423,600
神東塗料	7,600	134.00	1,018,400
中国塗料	22,500	1,440.00	32,400,000
日本特殊塗料	5,800	1,467.00	8,508,600
藤倉化成	18,500	500.00	9,250,000
太陽ホールディングス	20,900	2,631.00	54,987,900
D I C	53,700	2,512.00	134,894,400
サカタインクス	30,600	1,391.00	42,564,600
東洋インキS Cホールディングス	30,000	2,417.00	72,510,000
T & K T O K A	12,300	1,430.00	17,589,000
アルプス技研	13,400	2,640.00	35,376,000
サニックス	22,500	336.00	7,560,000
日本空調サービス	15,200	805.00	12,236,000
オリエンタルランド	746,800	5,101.00	3,809,426,800
フォーカスシステムズ	10,000	992.00	9,920,000
ダスキン	31,400	3,372.00	105,880,800
パーク24	87,800	2,022.50	177,575,500
明光ネットワークジャパン	17,200	648.00	11,145,600
ファルコホールディングス	6,400	1,991.00	12,742,400
クレスコ	10,600	1,871.00	19,832,600
フジ・メディア・ホールディングス	132,200	1,621.00	214,296,200
秀英予備校	2,300	408.00	938,400
田谷	1,600	479.00	766,400
ラウンドワン	118,000	585.00	69,030,000
リゾートトラスト	55,700	2,328.50	129,697,450
オービック	46,000	24,100.00	1,108,600,000
ジャストシステム	19,800	2,919.50	57,806,100
T D C ソフト	11,600	1,785.00	20,706,000
Zホールディングス	1,959,200	440.70	863,419,440
ビー・エム・エル	17,300	2,862.00	49,512,600
トレンドマイクロ	65,000	5,894.00	383,110,000
I Dホールディングス	9,300	1,415.00	13,159,500
リソー教育	64,100	246.00	15,768,600
日本オラクル	26,300	9,855.00	259,186,500
早稲田アカデミー	7,800	1,514.00	11,809,200
アルファシステムズ	4,400	2,975.00	13,090,000
フューチャー	29,300	1,471.00	43,100,300
C A C H o l d i n g s	7,300	1,786.00	13,037,800
S B テクノロジー	5,800	2,300.00	13,340,000
トーセ	2,600	737.00	1,916,200
ユー・エス・エス	145,100	2,501.00	362,895,100
オービックビジネスコンサルタント	27,100	5,970.00	161,787,000
アイティフォー	18,200	1,109.00	20,183,800
東京個別指導学院	16,700	490.00	8,183,000
東計電算	1,900	6,530.00	12,407,000
サイバーエージェント	311,700	828.60	258,274,620
楽天グループ	1,207,400	620.10	748,708,740
エックスネット	1,400	1,092.00	1,528,800

クリーク・アンド・リバー社	8,200	2,196.00	18,007,200	
SBIグローバルアセットマネジメント	23,000	574.00	13,202,000	
テー・オー・ダブリュー	28,100	313.00	8,795,300	
大塚商会	68,200	6,157.00	419,907,400	
サイボウズ	19,000	2,048.00	38,912,000	
山田コンサルティンググループ	7,200	1,665.00	11,988,000	
セントラルスポーツ	5,300	2,475.00	13,117,500	
パラカ	4,800	2,095.00	10,056,000	
電通国際情報サービス	16,700	5,630.00	94,021,000	
ACCESS	16,300	807.00	13,154,100	
デジタルガレージ	24,400	3,745.00	91,378,000	
イーエムシステムズ	23,000	750.00	17,250,000	
ウェザーニューズ	4,300	6,430.00	27,649,000	
CIJ	23,000	563.00	12,949,000	
ビジネスエンジニアリング	2,000	3,530.00	7,060,000	
日本エンタープライズ	9,400	132.00	1,240,800	
WOWOW	10,400	1,159.00	12,053,600	
スカラ	12,700	778.00	9,880,600	
インテリジェント ウェイブ	4,800	881.00	4,228,800	
フルキャストホールディングス	13,500	1,981.00	26,743,500	
エン・ジャパン	25,600	2,439.00	62,438,400	
あすか製薬ホールディングス	14,100	1,659.00	23,391,900	
サワイグループホールディングス	31,500	4,601.00	144,931,500	
富士フイルムホールディングス	264,100	9,113.00	2,406,743,300	
コニカミノルタ	309,600	501.30	155,202,480	
資生堂	287,400	5,702.00	1,638,754,800	
ライオン	180,100	1,471.00	264,927,100	
高砂香料工業	9,300	3,045.00	28,318,500	
マンダム	29,700	1,437.00	42,678,900	
ミルボン	18,700	4,715.00	88,170,500	
ファンケル	60,200	2,436.00	146,647,200	
コーセー	28,000	11,920.00	333,760,000	
コタ	12,600	1,630.00	20,538,000	
シーボン	1,300	1,546.00	2,009,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	70,500	1,816.50	128,063,250	
ノエビアホールディングス	12,300	5,700.00	70,110,000	
アジュバンホールディングス	2,200	943.00	2,074,600	
新日本製薬	7,800	1,583.00	12,347,400	
アクシージア	7,000	1,192.00	8,344,000	
エステー	10,600	1,537.00	16,292,200	
アグロ カネショウ	5,500	1,425.00	7,837,500	
コニシ	23,000	2,642.00	60,766,000	
長谷川香料	26,300	3,435.00	90,340,500	
星光PMC	5,600	1,067.00	5,975,200	
小林製薬	40,100	6,946.00	278,534,600	
荒川化学工業	11,600	1,075.00	12,470,000	
メック	11,400	3,770.00	42,978,000	
日本高純度化学	3,400	2,611.00	8,877,400	
タカラパイオ	37,000	1,418.00	52,466,000	

JCU	15,300	3,260.00	49,878,000
新田ゼラチン	5,600	718.00	4,020,800
OATアグリオ	3,400	1,820.00	6,188,000
デクセリアルズ	37,600	3,734.00	140,398,400
アース製薬	12,500	4,935.00	61,687,500
北興化学工業	13,900	971.00	13,496,900
大成ラミック	4,400	3,220.00	14,168,000
クミアイ化学工業	54,700	1,133.00	61,975,100
日本農薬	25,300	695.00	17,583,500
富士興産	2,200	1,947.00	4,283,400
ニチレキ	16,300	2,059.00	33,561,700
ユシロ化学工業	7,200	1,716.00	12,355,200
ビービー・カストロール	3,500	918.00	3,213,000
富士石油	28,100	381.00	10,706,100
MORESCO	3,000	1,212.00	3,636,000
出光興産	152,900	3,655.00	558,849,500
ENEOSホールディングス	2,335,300	637.60	1,488,987,280
コスモエネルギーホールディングス	54,500	5,830.00	317,735,000
ANYCOLOR	4,800	3,735.00	17,928,000
テスホールディングス	29,000	505.00	14,645,000
インフロニア・ホールディングス	141,100	1,623.00	229,005,300
横浜ゴム	69,600	3,303.00	229,888,800
TOYO TIRE	79,100	2,415.50	191,066,050
ブリヂストン	403,000	6,111.00	2,462,733,000
住友ゴム工業	135,000	1,707.50	230,512,500
藤倉コンポジット	6,500	1,194.00	7,761,000
オカモト	7,400	5,070.00	37,518,000
アキレス	8,700	1,510.00	13,137,000
フコク	7,200	1,540.00	11,088,000
ニッタ	14,000	3,530.00	49,420,000
クリエートメディック	3,000	928.00	2,784,000
住友理工	26,700	1,183.00	31,586,100
三ツ星ベルト	20,000	5,000.00	100,000,000
バンドー化学	20,500	1,719.00	35,239,500
AGC	128,500	5,380.00	691,330,000
日本板硝子	70,100	834.00	58,463,400
石塚硝子	1,500	2,742.00	4,113,000
有沢製作所	22,400	1,079.00	24,169,600
日本山村硝子	3,400	1,779.00	6,048,600
日本電気硝子	56,200	2,699.50	151,711,900
オハラ	6,600	1,259.00	8,309,400
住友大阪セメント	19,400	3,911.00	75,873,400
太平洋セメント	87,700	2,833.50	248,497,950
リソルホールディングス	800	4,860.00	3,888,000
日本ヒューム	12,000	903.00	10,836,000
日本コンクリート工業	26,500	347.00	9,195,500
三谷セキサン	5,700	5,140.00	29,298,000
アジアパイルホールディングス	21,500	697.00	14,985,500
東海カーボン	127,000	1,219.00	154,813,000
日本カーボン	7,300	4,595.00	33,543,500

東洋炭素	9,700	5,690.00	55,193,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	6,570.00	45,333,000
TOTO	90,900	3,965.00	360,418,500
日本碍子	160,100	2,033.50	325,563,350
日本特殊陶業	104,800	3,587.00	375,917,600
ダントーホールディングス	6,100	852.00	5,197,200
MARUWA	5,100	24,140.00	123,114,000
品川リフラクトリーズ	3,900	8,470.00	33,033,000
黒崎播磨	2,800	10,220.00	28,616,000
ヨータイ	7,400	1,553.00	11,492,200
東京窯業	8,500	350.00	2,975,000
ニッカトー	4,200	641.00	2,692,200
フジインコーポレーテッド	32,900	3,115.00	102,483,500
クニミネ工業	2,700	1,088.00	2,937,600
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,200.00	2,040,000
ニチアス	34,900	3,120.00	108,888,000
日本製鉄	634,200	3,750.00	2,378,250,000
神戸製鋼所	284,800	2,160.00	615,168,000
中山製鋼所	29,200	988.00	28,849,600
合同製鐵	7,100	5,130.00	36,423,000
JFEホールディングス	378,500	2,314.50	876,038,250
東京製鐵	39,900	1,805.00	72,019,500
共英製鋼	16,200	2,206.00	35,737,200
大和工業	23,400	7,456.00	174,470,400
東京鐵鋼	6,800	3,955.00	26,894,000
大阪製鐵	6,600	1,888.00	12,460,800
淀川製鋼所	16,200	3,945.00	63,909,000
中部鋼板	11,700	2,255.00	26,383,500
丸一鋼管	43,200	3,803.00	164,289,600
モリ工業	2,200	4,105.00	9,031,000
大同特殊鋼	17,800	6,463.00	115,041,400
日本高周波鋼業	3,300	700.00	2,310,000
日本冶金工業	10,300	5,080.00	52,324,000
山陽特殊製鋼	14,000	3,085.00	43,190,000
愛知製鋼	8,100	4,375.00	35,437,500
日本金属	2,100	934.00	1,961,400
大平洋金属	10,000	1,502.00	15,020,000
新日本電工	70,500	305.00	21,502,500
栗本鐵工所	6,800	2,849.00	19,373,200
虹 技	1,100	1,602.00	1,762,200
日本鑄鉄管	900	1,206.00	1,085,400
日本製鋼所	38,200	3,031.00	115,784,200
三菱製鋼	8,900	1,627.00	14,480,300
日亜鋼業	9,800	316.00	3,096,800
日本精線	2,000	4,990.00	9,980,000
エンピプロ・ホールディングス	6,500	640.00	4,160,000
大紀アルミニウム工業所	20,100	1,525.00	30,652,500
日本輕金属ホールディングス	38,300	1,797.00	68,825,100
三井金属鉱業	41,200	4,069.00	167,642,800
東邦亜鉛	8,300	1,744.00	14,475,200

三菱マテリアル	94,500	2,632.00	248,724,000
住友金属鉱山	164,300	4,748.00	780,096,400
DOWAホールディングス	31,800	4,996.00	158,872,800
古河機械金属	20,900	1,813.00	37,891,700
エス・サイエンス	57,000	23.00	1,311,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,800	3,245.00	67,496,000
東邦チタニウム	25,700	1,950.00	50,115,000
UACJ	19,800	3,350.00	66,330,000
CKサンエツ	2,700	3,805.00	10,273,500
古河電気工業	47,200	2,623.00	123,805,600
住友電気工業	489,000	1,865.00	911,985,000
フジクラ	151,800	1,249.50	189,674,100
SWCC	15,900	2,187.00	34,773,300
タツタ電線	28,700	701.00	20,118,700
カナレ電気	1,700	1,467.00	2,493,900
平河ヒューテック	8,100	1,466.00	11,874,600
いよぎんホールディングス	160,800	1,120.50	180,176,400
しずおかフィナンシャルグループ	300,300	1,275.50	383,032,650
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	113,700	1,166.00	132,574,200
楽天銀行	47,100	2,151.00	101,312,100
リョービ	15,000	3,280.00	49,200,000
アールスティ	10,400	907.00	9,432,800
AREホールディングス	57,300	1,957.00	112,136,100
東洋製罐グループホールディングス	84,500	2,802.00	236,769,000
ホッカンホールディングス	7,600	1,598.00	12,144,800
コロナ	8,000	944.00	7,552,000
横河ブリッジホールディングス	17,700	2,884.00	51,046,800
駒井ハルテック	1,600	1,927.00	3,083,200
高田機工	600	3,355.00	2,013,000
三和ホールディングス	130,400	2,126.00	277,230,400
文化シャッター	40,800	1,157.00	47,205,600
三協立山	16,200	947.00	15,341,400
アルインコ	10,700	1,092.00	11,684,400
東洋シャッター	2,200	654.00	1,438,800
LIXIL	206,300	1,838.00	379,179,400
日本フィルコン	6,200	488.00	3,025,600
ノーリツ	23,500	1,619.00	38,046,500
長府製作所	14,100	2,126.00	29,976,600
リンナイ	77,000	2,831.50	218,025,500
ユニプレス	24,600	1,288.00	31,684,800
ダイニチ工業	4,600	745.00	3,427,000
日東精工	20,600	567.00	11,680,200
三洋工業	1,100	2,167.00	2,383,700
岡部	25,400	760.00	19,304,000
ジーテクト	15,800	1,918.00	30,304,400
東プレ	24,900	1,847.00	45,990,300
高周波熱錬	21,800	1,074.00	23,413,200
東京製綱	8,300	1,384.00	11,487,200
サンコール	8,300	510.00	4,233,000
モリテックスチール	7,000	320.00	2,240,000



パイオラックス	19,500	2,469.00	48,145,500
エイチワン	14,500	888.00	12,876,000
日本発条	125,300	1,183.50	148,292,550
中央発條	10,400	769.00	7,997,600
アドバネクス	1,100	1,099.00	1,208,900
三浦工業	57,900	3,231.00	187,074,900
タクマ	42,600	1,615.00	68,799,000
テクノプロ・ホールディングス	83,500	3,234.00	270,039,000
アトラグループ	2,600	244.00	634,400
アイ・アールジャパンホールディングス	7,300	2,400.00	17,520,000
Keeper 技研	8,700	5,830.00	50,721,000
ファーストロジック	2,500	530.00	1,325,000
三機サービス	1,500	1,077.00	1,615,500
Gunosy	11,200	612.00	6,854,400
デザインワン・ジャパン	2,500	168.00	420,000
イー・ガーディアン	5,300	2,644.00	14,013,200
リブセンス	4,300	347.00	1,492,100
ジャパンマテリアル	43,200	2,355.00	101,736,000
ベクトル	22,100	1,296.00	28,641,600
ウチヤマホールディングス	4,000	374.00	1,496,000
チャーム・ケア・コーポレーション	11,800	1,118.00	13,192,400
キャリアリンク	5,200	2,498.00	12,989,600
IBJ	10,700	622.00	6,655,400
アサンテ	7,000	1,644.00	11,508,000
パリュールHR	12,300	1,274.00	15,670,200
M&Aキャピタルパートナーズ	11,400	2,794.00	31,851,600
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,000	1,004.00	5,020,000
ERIホールディングス	2,400	2,319.00	5,565,600
アビスト	1,500	3,570.00	5,355,000
シグマクシス・ホールディングス	21,400	1,540.00	32,956,000
ウィルグループ	11,800	1,118.00	13,192,400
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	9,600	146.00	1,401,600
メドピア	12,400	1,012.00	12,548,800
レアジョブ	1,800	1,031.00	1,855,800
リクルートホールディングス	1,044,600	5,062.00	5,287,765,200
エラン	18,700	843.00	15,764,100
ツガミ	30,800	1,221.00	37,606,800
オークマ	13,900	7,103.00	98,731,700
芝浦機械	13,900	4,170.00	57,963,000
アマダ	221,100	1,620.50	358,292,550
アイダエンジニアリング	28,500	1,036.00	29,526,000
TAKISAWA	2,400	2,592.00	6,220,800
FUJI	60,200	2,479.50	149,265,900
牧野フライス製作所	15,300	6,960.00	106,488,000
オーエスジー	61,000	1,851.00	112,911,000
ダイジェット工業	900	950.00	855,000
旭ダイヤモンド工業	38,700	930.00	35,991,000
DMG森精機	84,000	2,753.00	231,252,000

ソディック	33,800	769.00	25,992,200
ディスコ	66,800	26,340.00	1,759,512,000
日東工器	6,800	2,060.00	14,008,000
日進工具	11,600	1,089.00	12,632,400
パンチ工業	8,300	460.00	3,818,000
富士ダイス	4,300	661.00	2,842,300
土木管理総合試験所	4,400	342.00	1,504,800
日本郵政	1,697,900	1,267.00	2,151,239,300
ベルシステム24ホールディングス	18,900	1,640.00	30,996,000
鎌倉新書	16,000	654.00	10,464,000
S MN	2,200	415.00	913,000
一蔵	1,100	589.00	647,900
グローバルキッズCOMPANY	1,800	697.00	1,254,600
エアトリ	10,300	2,167.00	22,320,100
アトラエ	8,300	1,111.00	9,221,300
ストライク	5,900	3,440.00	20,296,000
ソラスト	38,800	636.00	24,676,800
セラク	4,300	1,299.00	5,585,700
インソース	30,600	1,017.00	31,120,200
豊田自動織機	100,400	12,595.00	1,264,538,000
豊和工業	5,000	805.00	4,025,000
石川製作所	2,400	1,282.00	3,076,800
東洋機械金属	6,400	736.00	4,710,400
津田駒工業	1,700	437.00	742,900
エンシュウ	2,000	815.00	1,630,000
島精機製作所	22,000	1,945.00	42,790,000
オプトラン	22,700	1,861.00	42,244,700
NCホールディングス	1,900	1,645.00	3,125,500
イワキ	9,200	1,970.00	18,124,000
フリー	14,500	1,687.00	24,461,500
ヤマシンフィルタ	33,100	359.00	11,882,900
日阪製作所	13,500	1,006.00	13,581,000
やまびこ	22,600	1,527.00	34,510,200
野村マイクロ・サイエンス	4,700	6,150.00	28,905,000
平田機工	6,600	7,670.00	50,622,000
PEGASUS	15,300	630.00	9,639,000
マルマエ	6,100	1,729.00	10,546,900
タツモ	8,300	2,973.00	24,675,900
ナブテスコ	87,000	2,770.00	240,990,000
三井海洋開発	17,500	2,090.00	36,575,000
レオン自動機	14,600	1,403.00	20,483,800
S MC	45,000	69,550.00	3,129,750,000
ホソカワミクロン	8,900	4,400.00	39,160,000
ユニオンツール	6,100	3,700.00	22,570,000
瑞光	10,000	1,365.00	13,650,000
オイレス工業	19,400	2,089.00	40,526,600
日精エー・エス・ビー機械	5,500	4,660.00	25,630,000
サトーホールディングス	19,700	2,136.00	42,079,200
技研製作所	13,000	2,068.00	26,884,000
日本エアーテック	6,500	1,300.00	8,450,000

カワタ	2,700	1,106.00	2,986,200	
日精樹脂工業	10,300	1,065.00	10,969,500	
オカダアイヨン	2,800	2,097.00	5,871,600	
ワイエイシイホールディングス	3,900	2,812.00	10,966,800	
小松製作所	649,600	4,509.00	2,929,046,400	
住友重機械工業	82,000	3,936.00	322,752,000	
日立建機	55,200	4,914.00	271,252,800	
日工	20,500	697.00	14,288,500	
巴工業	5,400	3,095.00	16,713,000	
井関農機	12,900	1,214.00	15,660,600	
TOWA	14,100	3,520.00	49,632,000	
丸山製作所	1,600	2,392.00	3,827,200	
北川鉄工所	5,400	1,562.00	8,434,800	
シンニッタン	10,000	253.00	2,530,000	
ローツェ	7,200	10,560.00	76,032,000	
タカキタ	2,600	502.00	1,305,200	
クボタ	727,500	2,405.50	1,750,001,250	
荏原実業	7,300	2,981.00	21,761,300	
東洋エンジニアリング	17,700	696.00	12,319,200	
三菱化工機	4,500	2,855.00	12,847,500	
月島ホールディングス	18,800	1,398.00	26,282,400	
帝国電機製作所	9,700	2,700.00	26,190,000	
東京機械製作所	2,200	408.00	897,600	
新東工業	28,000	1,156.00	32,368,000	
澁谷工業	13,000	2,619.00	34,047,000	
アイチコーポレーション	19,300	1,000.00	19,300,000	
小森コーポレーション	32,100	1,140.00	36,594,000	
鶴見製作所	10,500	3,275.00	34,387,500	
日本ギア工業	3,000	400.00	1,200,000	
酒井重工業	1,500	5,440.00	8,160,000	
荏原製作所	56,900	7,365.00	419,068,500	
石井鐵工所	1,000	3,070.00	3,070,000	
西島製作所	11,900	2,007.00	23,883,300	
北越工業	13,900	2,169.00	30,149,100	
ダイキン工業	165,500	24,915.00	4,123,432,500	
オルガノ	19,000	3,965.00	75,335,000	
トーヨーカネツ	5,200	3,535.00	18,382,000	
栗田工業	77,500	5,495.00	425,862,500	
椿本チエイン	19,600	4,060.00	79,576,000	
大同工業	3,700	772.00	2,856,400	
日機装	31,900	1,038.00	33,112,200	
木村化工機	10,500	772.00	8,106,000	
レイズネクスト	19,500	1,550.00	30,225,000	
アネスト岩田	23,600	1,225.00	28,910,000	
ダイフク	214,500	2,857.50	612,933,750	
サムコ	3,800	4,465.00	16,967,000	
加藤製作所	4,400	1,286.00	5,658,400	
油研工業	1,400	2,334.00	3,267,600	
タダノ	79,700	1,328.00	105,841,600	
フジテック	48,600	3,676.00	178,653,600	

CKD	38,400	2,120.00	81,408,000
平和	46,100	2,270.00	104,647,000
理想科学工業	11,100	2,448.00	27,172,800
SANKYO	27,200	6,603.00	179,601,600
日本金銭機械	15,200	1,019.00	15,488,800
マースグループホールディングス	8,100	2,958.00	23,959,800
フクシマガリレイ	10,200	5,200.00	53,040,000
オーイズミ	3,400	419.00	1,424,600
ダイコク電機	7,600	5,780.00	43,928,000
竹内製作所	25,100	5,130.00	128,763,000
アマノ	39,300	3,398.00	133,541,400
JUKI	21,500	639.00	13,738,500
サンデン	13,900	195.00	2,710,500
ジャノメ	13,900	723.00	10,049,700
ブラザー工業	185,200	2,535.00	469,482,000
マックス	17,100	2,781.00	47,555,100
モリタホールディングス	24,100	1,690.00	40,729,000
グローリー	33,300	3,214.00	107,026,200
新晃工業	14,000	2,098.00	29,372,000
大和冷機工業	21,200	1,474.00	31,248,800
セガサミーホールディングス	111,500	2,778.50	309,802,750
日本ピストンリング	3,100	1,801.00	5,583,100
リケン	5,400	3,550.00	19,170,000
TPR	15,900	1,938.00	30,814,200
ツバキ・ナカシマ	27,900	819.00	22,850,100
ホシザキ	81,800	5,775.00	472,395,000
大豊工業	12,000	970.00	11,640,000
日本精工	254,700	881.30	224,467,110
NTN	273,300	295.30	80,705,490
ジェイテクト	123,300	1,506.00	185,689,800
不二越	10,200	4,225.00	43,095,000
ミネベアミツミ	241,200	2,482.50	598,779,000
日本トムソン	33,900	579.00	19,628,100
THK	80,000	2,725.00	218,000,000
ユーシン精機	11,000	703.00	7,733,000
前澤給装工業	9,800	1,244.00	12,191,200
イーグル工業	15,300	1,838.00	28,121,400
前澤工業	5,200	1,044.00	5,428,800
日本ピラー工業	12,800	4,110.00	52,608,000
キッツ	46,400	1,092.00	50,668,800
日立製作所	674,100	9,947.00	6,705,272,700
東芝	266,700	4,593.00	1,224,953,100
三菱電機	1,432,800	1,930.50	2,766,020,400
富士電機	84,300	6,953.00	586,137,900
東洋電機製造	3,000	1,038.00	3,114,000
安川電機	164,300	5,761.00	946,532,300
シンフォニアテクノロジー	15,300	1,642.00	25,122,600
明電舎	21,000	2,271.00	47,691,000
オリジン	2,100	1,301.00	2,732,100
山洋電気	5,900	6,920.00	40,828,000

デンヨー	10,500	2,180.00	22,890,000
PHCホールディングス	19,300	1,567.00	30,243,100
ソシオネクスト	19,700	14,830.00	292,151,000
ベイクレント・コンサルティング	111,700	4,970.00	555,149,000
Orchestra Holdings	3,000	1,054.00	3,162,000
アイモバイル	6,300	1,306.00	8,227,800
キャリアインデックス	3,200	295.00	944,000
MS-Japan	3,000	1,195.00	3,585,000
船場	1,500	936.00	1,404,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	50,300	2,157.00	108,497,100
フルテック	1,400	1,217.00	1,703,800
グリーンズ	3,100	1,707.00	5,291,700
ツナグループ・ホールディングス	2,600	855.00	2,223,000
GAMEWITH	2,800	327.00	915,600
MS&Consulting	1,100	695.00	764,500
ウェルビー	10,300	586.00	6,035,800
エル・ティー・エス	1,700	3,810.00	6,477,000
ミダックホールディングス	8,600	1,835.00	15,781,000
日総工産	10,500	765.00	8,032,500
キュービーネットホールディングス	6,700	1,531.00	10,257,700
RPAホールディングス	19,100	340.00	6,494,000
三櫻工業	20,900	1,004.00	20,983,600
マキタ	172,500	4,015.00	692,587,500
東芝テック	20,700	3,490.00	72,243,000
芝浦メカトロニクス	2,400	21,100.00	50,640,000
マブチモーター	34,400	4,628.00	159,203,200
ニデック	337,300	7,333.00	2,473,420,900
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	10,100	517.00	5,221,700
トレックス・セミコンダクター	6,500	2,237.00	14,540,500
東光高岳	8,300	2,192.00	18,193,600
ダブル・スコープ	39,700	1,122.00	44,543,400
宮越ホールディングス	6,200	1,209.00	7,495,800
ダイヘン	12,500	5,260.00	65,750,000
ヤーマン	24,000	1,063.00	25,512,000
JVCケンウッド	126,300	667.00	84,242,100
ミマキエンジニアリング	13,100	797.00	10,440,700
I-PEX	9,600	1,605.00	15,408,000
大崎電気工業	33,000	701.00	23,133,000
オムロン	127,000	6,905.00	876,935,000
日東工業	18,700	3,880.00	72,556,000
IDEC	20,500	3,095.00	63,447,500
正興電機製作所	3,000	1,134.00	3,402,000
不二電機工業	1,900	1,128.00	2,143,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	45,500	2,714.50	123,509,750
サクサホールディングス	1,900	2,508.00	4,765,200
メルコホールディングス	3,400	3,210.00	10,914,000
テクノメディカ	3,300	2,116.00	6,982,800

ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,700	863.00	4,056,100	
日本電気	196,100	8,400.00	1,647,240,000	
富士通	138,200	18,665.00	2,579,503,000	
沖電気工業	62,700	1,120.00	70,224,000	
岩崎通信機	4,100	837.00	3,431,700	
電気興業	5,600	2,528.00	14,156,800	
サンケン電気	12,800	9,370.00	119,936,000	
ナカヨ	1,600	1,289.00	2,062,400	
アイホン	8,500	3,135.00	26,647,500	
ルネサスエレクトロニクス	904,800	2,264.50	2,048,919,600	
セイコーエプソン	177,900	2,402.50	427,404,750	
ワコム	105,400	619.00	65,242,600	
アルバック	33,000	5,474.00	180,642,000	
アクセル	3,400	1,882.00	6,398,800	
E I Z O	10,100	5,170.00	52,217,000	
ジャパンディスプレイ	532,400	40.00	21,296,000	
日本信号	31,500	972.00	30,618,000	
京三製作所	29,000	503.00	14,587,000	
能美防災	18,800	1,856.00	34,892,800	
ホーチキ	10,300	1,667.00	17,170,100	
星和電機	4,100	498.00	2,041,800	
エレコム	33,200	1,801.00	59,793,200	
パナソニック ホールディングス	1,637,500	1,784.00	2,921,300,000	
シャープ	166,900	938.50	156,635,650	
アンリツ	97,600	1,102.50	107,604,000	
富士通ゼネラル	39,200	2,817.50	110,446,000	
ソニーグループ	970,900	12,805.00	12,432,374,500	
T D K	219,500	5,678.00	1,246,321,000	
帝国通信工業	6,300	1,919.00	12,089,700	
タムラ製作所	59,500	582.00	34,629,000	
アルプスアルパイン	123,900	1,297.00	160,698,300	
池上通信機	2,900	792.00	2,296,800	
日本電波工業	16,600	1,417.00	23,522,200	
鈴木	7,400	1,173.00	8,680,200	
メイコー	15,100	3,510.00	53,001,000	
日本トリム	3,100	3,115.00	9,656,500	
ローランド ディー・ジー	7,600	3,480.00	26,448,000	
フォスター電機	12,800	977.00	12,505,600	
S M K	3,300	2,546.00	8,401,800	
ヨコオ	11,100	1,656.00	18,381,600	
ティアック	14,300	114.00	1,630,200	
ホシデン	32,400	1,957.00	63,406,800	
ヒロセ電機	22,300	17,540.00	391,142,000	
日本航空電子工業	28,400	3,065.00	87,046,000	
T O A	15,800	1,220.00	19,276,000	
マクセル	28,100	1,711.00	48,079,100	
古野電気	17,900	1,392.00	24,916,800	
スミダコーポレーション	18,600	1,506.00	28,011,600	
アイコム	5,300	3,435.00	18,205,500	

リオン	5,700	2,301.00	13,115,700	
横河電機	151,600	2,999.00	454,648,400	
新電元工業	5,300	3,165.00	16,774,500	
アズビル	95,900	4,820.00	462,238,000	
東亜ディーケーケー	4,400	880.00	3,872,000	
日本光電工業	63,300	3,863.00	244,527,900	
チノー	5,700	2,076.00	11,833,200	
共和電業	8,600	370.00	3,182,000	
日本電子材料	9,100	1,484.00	13,504,400	
堀場製作所	26,200	7,975.00	208,945,000	
アドバンテスト	108,100	15,955.00	1,724,735,500	
小野測器	3,800	462.00	1,755,600	
エスベック	11,000	2,435.00	26,785,000	
キーエンス	137,300	57,610.00	7,909,853,000	
日置電機	6,500	7,420.00	48,230,000	
シスメックス	118,400	7,682.00	909,548,800	
日本マイクロニクス	24,600	1,986.00	48,855,600	
メガチップス	11,300	4,125.00	46,612,500	
OBARA GROUP	7,500	4,145.00	31,087,500	
IMAGICA GROUP	11,500	598.00	6,877,000	
澤藤電機	1,000	1,278.00	1,278,000	
デンソー	283,100	10,285.00	2,911,683,500	
原田工業	4,000	844.00	3,376,000	
コーセル	16,500	1,287.00	21,235,500	
イリソ電子工業	12,600	4,330.00	54,558,000	
オプテックスグループ	25,100	1,694.00	42,519,400	
千代田インテグレ	5,400	2,848.00	15,379,200	
レーザーテック	62,900	21,635.00	1,360,841,500	
スタンレー電気	96,600	2,482.50	239,809,500	
ウシオ電機	69,700	1,847.00	128,735,900	
岡谷電機産業	7,100	324.00	2,300,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	8,500	424.00	3,604,000	
エノモト	2,300	1,729.00	3,976,700	
日本セラミック	11,200	2,608.00	29,209,600	
遠藤照明	4,100	1,277.00	5,235,700	
古河電池	10,000	999.00	9,990,000	
双信電機	3,700	348.00	1,287,600	
山一電機	11,200	1,765.00	19,768,000	
図研	11,900	4,180.00	49,742,000	
日本電子	34,400	4,641.00	159,650,400	
カシオ計算機	102,300	1,281.50	131,097,450	
ファナック	669,300	4,049.00	2,709,995,700	
日本シイエムケイ	29,100	667.00	19,409,700	
エンプラス	4,000	10,040.00	40,160,000	
大真空	16,700	782.00	13,059,400	
ローム	63,400	11,385.00	721,809,000	
浜松ホトニクス	110,100	6,601.00	726,770,100	
三井ハイテック	14,200	8,090.00	114,878,000	
新光電気工業	48,500	5,847.00	283,579,500	
京セラ	213,200	7,745.00	1,651,234,000	

協栄産業	800	2,324.00	1,859,200	
太陽誘電	66,900	4,270.00	285,663,000	
村田製作所	416,300	8,268.00	3,441,968,400	
双葉電子工業	26,100	558.00	14,563,800	
日東電工	100,000	10,160.00	1,016,000,000	
北陸電気工業	3,400	1,505.00	5,117,000	
東海理化電機製作所	38,700	2,463.00	95,318,100	
ニチコン	28,100	1,362.00	38,272,200	
日本ケミコン	13,600	1,462.00	19,883,200	
K O A	20,800	1,845.00	38,376,000	
三井E & S	66,300	631.00	41,835,300	
日立造船	113,500	900.00	102,150,000	
三菱重工業	242,400	8,789.00	2,130,453,600	
川崎重工業	103,400	3,918.00	405,121,200	
I H I	87,300	3,234.00	282,328,200	
名村造船所	23,500	969.00	22,771,500	
サノヤホールディングス	12,100	143.00	1,730,300	
スプリックス	2,700	850.00	2,295,000	
マネジメントソリューションズ	6,100	3,110.00	18,971,000	
プロレド・パートナーズ	3,400	484.00	1,645,600	
and factory	2,800	367.00	1,027,600	
テノ・ホールディングス	1,100	616.00	677,600	
フロンティア・マネジメント	3,500	1,341.00	4,693,500	
ピアラ	1,800	420.00	756,000	
コプロ・ホールディングス	1,600	2,504.00	4,006,400	
ギークス	1,300	728.00	946,400	
アンビスホールディングス	15,100	2,865.00	43,261,500	
カーブスホールディングス	38,600	737.00	28,448,200	
フォーラムエンジニアリング	8,200	1,304.00	10,692,800	
FAST FITNESS JAPAN	4,800	1,364.00	6,547,200	
日本車輛製造	5,300	2,198.00	11,649,400	
三菱ロジスネクスト	21,900	1,410.00	30,879,000	
近畿車輛	1,300	2,073.00	2,694,900	
一家ホールディングス	2,200	708.00	1,557,600	
フルサト・マルカホールディングス	13,100	2,790.00	36,549,000	
ヤマエグループホールディングス	8,200	3,775.00	30,955,000	
ジャパクラフトホールディングス	5,400	227.00	1,225,800	
F P G	45,700	1,502.00	68,641,400	
島根銀行	3,200	595.00	1,904,000	
じもとホールディングス	8,100	456.00	3,693,600	
全国保証	35,400	5,005.00	177,177,000	
めぶきフィナンシャルグループ	670,500	434.50	291,332,250	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,100	1,869.00	20,745,900	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,300	4,725.00	81,742,500	
九州フィナンシャルグループ	237,700	807.60	191,966,520	
かんぽ生命保険	157,400	2,625.00	413,175,000	
ゆうちょ銀行	371,400	1,321.00	490,619,400	
あんしん保証	4,500	297.00	1,336,500	



富山第一銀行	42,900	1,038.00	44,530,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	725,500	726.30	526,930,650
ジェイリース	3,000	2,174.00	6,522,000
西日本フィナンシャルホールディングス	83,900	1,735.00	145,566,500
イントラスト	3,400	910.00	3,094,000
日本モーゲージサービス	5,000	575.00	2,875,000
CASA	3,500	881.00	3,083,500
アルヒ	16,700	947.00	15,814,900
プレミアグループ	22,700	1,589.00	36,070,300
日産自動車	1,949,800	710.10	1,384,552,980
いすゞ自動車	399,100	2,023.50	807,578,850
トヨタ自動車	7,537,100	2,880.00	21,706,848,000
日野自動車	177,000	612.00	108,324,000
三菱自動車工業	535,500	662.60	354,822,300
エフテック	6,400	883.00	5,651,200
レシップホールディングス	3,800	568.00	2,158,400
GMB	1,800	2,160.00	3,888,000
ファルテック	1,400	585.00	819,000
武蔵精密工業	33,500	1,703.00	57,050,500
日産車体	24,200	923.00	22,336,600
新明和工業	43,100	1,327.00	57,193,700
極東開発工業	22,600	1,878.00	42,442,800
トビー工業	11,100	2,711.00	30,092,100
ティラド	3,400	2,321.00	7,891,400
曙ブレーキ工業	83,600	144.00	12,038,400
タチエス	21,700	1,861.00	40,383,700
NOK	53,300	2,134.00	113,742,200
フタバ産業	36,700	800.00	29,360,000
KYB	13,300	5,120.00	68,096,000
市光工業	24,700	590.00	14,573,000
大同メタル工業	26,800	585.00	15,678,000
プレス工業	61,300	723.00	44,319,900
ミクニ	10,400	512.00	5,324,800
太平洋工業	31,500	1,562.00	49,203,000
河西工業	12,100	298.00	3,605,800
アイシン	105,900	5,908.00	625,657,200
マツダ	454,100	1,852.50	841,220,250
今仙電機製作所	5,700	679.00	3,870,300
本田技研工業	1,115,800	5,407.00	6,033,130,600
スズキ	252,100	6,291.00	1,585,961,100
SUBARU	434,300	3,094.00	1,343,724,200
安永	4,000	860.00	3,440,000
ヤマハ発動機	197,800	4,127.00	816,320,600
小糸製作所	165,100	2,347.00	387,489,700
TBK	9,100	473.00	4,304,300
エクセディ	22,400	2,802.00	62,764,800
ミツバ	25,800	811.00	20,923,800
豊田合成	40,100	3,475.00	139,347,500

愛三工業	22,600	1,403.00	31,707,800
盟和産業	1,300	1,040.00	1,352,000
日本プラスト	7,200	509.00	3,664,800
ヨロズ	12,800	990.00	12,672,000
エフ・シー・シー	24,300	1,978.00	48,065,400
新家工業	2,100	2,867.00	6,020,700
シマノ	55,700	20,470.00	1,140,179,000
テイ・エス テック	62,800	1,785.50	112,129,400
三十三フィナンシャルグループ	12,100	1,980.00	23,958,000
第四北越フィナンシャルグループ	21,200	4,025.00	85,330,000
ひろぎんホールディングス	176,400	986.50	174,018,600
マーキュリアホールディングス	4,700	798.00	3,750,600
おきなわフィナンシャルグループ	12,400	2,553.00	31,657,200
ダイレクトマーケティングミックス	14,500	522.00	7,569,000
ポピンズ	2,100	1,273.00	2,673,300
LITALICO	11,000	2,125.00	23,375,000
コンフィデンス・インターワークス	500	1,614.00	807,000
十六フィナンシャルグループ	17,500	4,045.00	70,787,500
北國フィナンシャルホールディングス	14,200	5,890.00	83,638,000
ネットプロテクションズホールディングス	44,800	392.00	17,561,600
プロクレアホールディングス	16,500	2,089.00	34,468,500
あいちフィナンシャルグループ	18,900	2,648.00	50,047,200
ジャムコ	5,000	1,641.00	8,205,000
小野建	14,300	1,786.00	25,539,800
はるやまホールディングス	4,200	528.00	2,217,600
南陽	1,900	2,288.00	4,347,200
ノジマ	47,400	1,313.00	62,236,200
佐島電機	6,100	1,804.00	11,004,400
カッパ・クリエイト	22,900	1,578.00	36,136,200
エコートレーディング	1,900	1,392.00	2,644,800
伯東	8,300	5,470.00	45,401,000
コンドーテック	11,200	1,200.00	13,440,000
中山福	5,100	360.00	1,836,000
ライトオン	7,300	513.00	3,744,900
ナガイレーベン	18,400	2,307.00	42,448,800
三菱食品	13,400	4,135.00	55,409,000
良品計画	158,500	1,952.50	309,471,250
パリミキホールディングス	12,100	387.00	4,682,700
松田産業	11,100	2,334.00	25,907,400
第一興商	56,200	2,630.00	147,806,000
メディバルホールディングス	138,900	2,644.00	367,251,600
アドヴァングループ	13,800	1,053.00	14,531,400
S P K	6,500	2,090.00	13,585,000
萩原電気ホールディングス	5,800	4,235.00	24,563,000
アルビス	4,700	2,460.00	11,562,000
アズワン	20,700	5,831.00	120,701,700
スズデン	5,100	2,346.00	11,964,600
尾家産業	2,300	2,021.00	4,648,300
シモジマ	9,900	1,232.00	12,196,800

ドウシシャ	15,300	2,358.00	36,077,400
小津産業	2,200	1,636.00	3,599,200
コナカ	10,500	462.00	4,851,000
高速	7,500	2,099.00	15,742,500
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,619.00	2,104,700
G - 7ホールディングス	18,100	1,302.00	23,566,200
たけびし	5,500	1,953.00	10,741,500
イオン北海道	21,500	871.00	18,726,500
コジマ	24,000	635.00	15,240,000
ヒマラヤ	3,000	946.00	2,838,000
コーナン商事	19,600	3,595.00	70,462,000
ネットワンシステムズ	51,200	2,789.50	142,822,400
エコス	5,400	2,086.00	11,264,400
ワタミ	17,500	1,156.00	20,230,000
マルシェ	3,300	297.00	980,100
リックス	2,000	3,330.00	6,660,000
システムソフト	47,700	77.00	3,672,900
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	293,200	3,101.00	909,213,200
丸文	12,900	1,243.00	16,034,700
西松屋チェーン	32,100	1,649.00	52,932,900
ゼンショーホールディングス	79,500	6,599.00	524,620,500
ハビネット	12,300	2,596.00	31,930,800
幸楽苑ホールディングス	9,400	1,038.00	9,757,200
ハークスレイ	3,300	771.00	2,544,300
橋本総業ホールディングス	5,700	1,175.00	6,697,500
日本ライフライン	42,600	1,229.00	52,355,400
サイゼリヤ	21,500	4,655.00	100,082,500
タカショー	12,600	649.00	8,177,400
V Tホールディングス	55,100	529.00	29,147,900
アルゴグラフィックス	12,600	3,525.00	44,415,000
魚力	4,500	2,215.00	9,967,500
I D O M	43,900	740.00	32,486,000
日本エム・ディ・エム	8,100	765.00	6,196,500
ポブラ	2,500	224.00	560,000
フジ・コーポレーション	7,200	2,057.00	14,810,400
ユナイテッドアローズ	15,500	2,045.00	31,697,500
進和	8,900	2,447.00	21,778,300
エスケイジャパン	2,300	712.00	1,637,600
ダイトロン	5,700	3,105.00	17,698,500
ハイデイ日高	21,500	2,876.00	61,834,000
シークス	20,700	1,571.00	32,519,700
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	5,700	185.00	1,054,500
コロワイド	66,900	2,514.50	168,220,050
田中商事	2,700	727.00	1,962,900
オーハシテクニカ	7,000	1,730.00	12,110,000
壱番屋	11,500	5,490.00	63,135,000
白銅	5,300	2,446.00	12,963,800
トップカルチャー	3,100	191.00	592,100

PLANT	2,200	810.00	1,782,000
スギホールディングス	29,200	6,309.00	184,222,800
ダイコー通産	900	1,210.00	1,089,000
薬王堂ホールディングス	8,100	2,758.00	22,339,800
島津製作所	167,200	4,152.00	694,214,400
JMS	12,600	555.00	6,993,000
クボテック	2,100	268.00	562,800
長野計器	10,000	2,632.00	26,320,000
ブイ・テクノロジー	6,700	2,232.00	14,954,400
スター精密	26,200	1,919.00	50,277,800
東京計器	10,500	1,537.00	16,138,500
愛知時計電機	5,400	1,769.00	9,552,600
インターアクション	6,500	1,044.00	6,786,000
オーバル	8,000	423.00	3,384,000
東京精密	30,200	7,340.00	221,668,000
マニー	54,900	1,897.00	104,145,300
ニコン	198,500	1,644.50	326,433,250
トプコン	72,200	1,763.00	127,288,600
オリンパス	844,900	2,082.00	1,759,081,800
理研計器	8,500	5,900.00	50,150,000
SCREENホールディングス	23,500	13,935.00	327,472,500
キヤノン電子	15,200	1,885.00	28,652,000
タムロン	8,500	4,395.00	37,357,500
HOYA	290,800	16,095.00	4,680,426,000
シード	4,600	814.00	3,744,400
ノーリツ鋼機	13,000	3,275.00	42,575,000
A&Dホロンホールディングス	20,000	1,743.00	34,860,000
朝日インテック	153,400	2,915.00	447,161,000
キヤノン	684,600	3,684.00	2,522,066,400
リコー	344,200	1,339.50	461,055,900
シチズン時計	126,300	953.00	120,363,900
リズム	2,800	1,814.00	5,079,200
大研医器	6,800	550.00	3,740,000
メニコン	47,200	2,058.50	97,161,200
シンシア	1,000	551.00	551,000
KYORITSU	13,700	201.00	2,753,700
中本パックス	2,800	1,654.00	4,631,200
スノーピーク	19,600	1,380.00	27,048,000
パラマウントベッドホールディングス	31,700	2,424.00	76,840,800
トランザクション	9,100	1,942.00	17,672,200
粧美堂	2,500	524.00	1,310,000
ニホンフラッシュ	12,800	908.00	11,622,400
前田工織	11,600	3,065.00	35,554,000
永大産業	9,600	231.00	2,217,600
アートネイチャー	14,200	839.00	11,913,800
パンダイナムコホールディングス	376,000	3,264.00	1,227,264,000
アイフィスジャパン	2,600	613.00	1,593,800
SHOEI	31,000	2,459.00	76,229,000
フランスベッドホールディングス	15,800	1,245.00	19,671,000
マーベラス	22,200	731.00	16,228,200

パイロットコーポレーション	19,300	5,072.00	97,889,600
萩原工業	9,200	1,861.00	17,121,200
エイベックス	23,400	1,499.00	35,076,600
フジシールインターナショナル	27,800	1,808.00	50,262,400
タカラトミー	62,400	2,303.00	143,707,200
広済堂ホールディングス	6,200	2,859.00	17,725,800
エステールホールディングス	2,200	645.00	1,419,000
レック	19,600	967.00	18,953,200
タカノ	3,300	919.00	3,032,700
三光合成	17,300	706.00	12,213,800
プロネクス	11,400	1,164.00	13,269,600
ホクシン	6,800	132.00	897,600
ウッドワン	3,000	1,088.00	3,264,000
大建工業	8,300	3,045.00	25,273,500
きもと	13,500	192.00	2,592,000
凸版印刷	168,700	3,837.00	647,301,900
大日本印刷	150,000	4,064.00	609,600,000
共同印刷	3,900	3,360.00	13,104,000
N I S S H A	23,500	1,716.00	40,326,000
光村印刷	600	1,396.00	837,600
藤森工業	10,900	3,965.00	43,218,500
ヴィア・ホールディングス	15,200	104.00	1,580,800
TAKARA & COMPANY	8,800	2,524.00	22,211,200
前澤化成工業	8,900	1,535.00	13,661,500
未来工業	4,900	3,315.00	16,243,500
アシックス	117,000	5,672.00	663,624,000
ツツミ	2,400	2,444.00	5,865,600
ウェーブロックホールディングス	2,600	675.00	1,755,000
J S P	9,700	2,067.00	20,049,900
ニチハ	17,200	3,135.00	53,922,000
ローランド	10,100	4,030.00	40,703,000
エフピコ	26,100	2,607.50	68,055,750
小松ウオール工業	5,000	3,080.00	15,400,000
ヤマハ	86,500	4,315.00	373,247,500
河合楽器製作所	3,700	3,570.00	13,209,000
クリナップ	15,300	735.00	11,245,500
ビジョン	87,500	1,693.50	148,181,250
天馬	11,300	2,623.00	29,639,900
キングジム	12,100	883.00	10,684,300
象印マホービン	37,300	1,843.00	68,743,900
リンテック	27,600	2,477.00	68,365,200
信越ポリマー	25,500	1,366.00	34,833,000
東リ	20,700	342.00	7,079,400
イトーキ	28,200	1,464.00	41,284,800
任天堂	866,600	6,451.00	5,590,436,600
三菱鉛筆	19,500	1,980.00	38,610,000
松風	6,200	2,234.00	13,850,800
タカラスタANDARD	25,400	1,907.00	48,437,800
コクヨ	59,500	2,416.00	143,752,000
ナカバヤシ	14,700	531.00	7,805,700

ニフコ	49,700	4,215.00	209,485,500	
立川ブラインド工業	6,400	1,473.00	9,427,200	
グロープライド	11,100	2,069.00	22,965,900	
オカムラ	41,300	2,319.00	95,774,700	
バルカー	11,500	4,320.00	49,680,000	
MUTOHホールディングス	1,300	2,020.00	2,626,000	
伊藤忠商事	894,900	5,757.00	5,151,939,300	
丸紅	1,133,300	2,539.00	2,877,448,700	
スクロール	21,500	1,039.00	22,338,500	
高島	1,600	4,020.00	6,432,000	
ヨンドシーホールディングス	12,400	1,872.00	23,212,800	
三陽商会	3,500	2,121.00	7,423,500	
長瀬産業	66,600	2,550.00	169,830,000	
ナイガイ	3,100	289.00	895,900	
蝶理	7,800	3,085.00	24,063,000	
豊田通商	127,200	9,186.00	1,168,459,200	
オンワードホールディングス	89,100	550.00	49,005,000	
三共生興	20,200	806.00	16,281,200	
兼松	56,400	2,231.00	125,828,400	
美津濃	13,700	4,860.00	66,582,000	
ツカモトコーポレーション	1,400	1,288.00	1,803,200	
ルックホールディングス	2,800	2,077.00	5,815,600	
三井物産	1,030,600	5,832.00	6,010,459,200	
日本紙パルプ商事	7,700	5,160.00	39,732,000	
東京エレクトロン	290,500	20,750.00	6,027,875,000	
カメイ	15,400	1,559.00	24,008,600	
東都水産	500	6,570.00	3,285,000	
OUGホールディングス	1,500	2,525.00	3,787,500	
スターゼン	11,100	2,650.00	29,415,000	
セイコーグループ	21,300	2,759.00	58,766,700	
山善	39,100	1,235.00	48,288,500	
椿本興業	2,300	5,440.00	12,512,000	
住友商事	878,800	3,216.00	2,826,220,800	
BIPROGY	50,600	3,839.00	194,253,400	
内田洋行	5,800	6,850.00	39,730,000	
三菱商事	885,500	7,688.00	6,807,724,000	
第一実業	5,100	5,950.00	30,345,000	
キャノンマーケティングジャパン	33,700	3,850.00	129,745,000	
西華産業	5,700	2,200.00	12,540,000	
佐藤商事	10,200	1,599.00	16,309,800	
菱洋エレクトロ	12,400	3,335.00	41,354,000	
東京産業	13,300	884.00	11,757,200	
ユアサ商事	12,500	4,320.00	54,000,000	
神鋼商事	3,700	6,170.00	22,829,000	
トルク	5,300	281.00	1,489,300	
阪和興業	26,100	5,060.00	132,066,000	
正栄食品工業	9,700	5,130.00	49,761,000	
カナデン	9,700	1,386.00	13,444,200	
RYODEN	11,800	2,417.00	28,520,600	
ニプロ	114,400	1,227.00	140,368,800	

岩谷産業	33,100	7,923.00	262,251,300
ナイス	2,600	1,523.00	3,959,800
ニチモウ	1,300	4,275.00	5,557,500
極東貿易	8,700	1,976.00	17,191,200
アステナホールディングス	27,200	484.00	13,164,800
三愛オブリ	38,400	1,828.00	70,195,200
稲畑産業	28,700	3,280.00	94,136,000
G S Iクレオス	8,500	2,338.00	19,873,000
明和産業	19,300	679.00	13,104,700
クワザワホールディングス	3,000	570.00	1,710,000
キムラタン	54,400	20.00	1,088,000
ゴールドウイン	24,300	10,840.00	263,412,000
ユニ・チャーム	286,800	5,505.00	1,578,834,000
デサント	23,700	3,815.00	90,415,500
キング	4,100	677.00	2,775,700
ワキタ	26,700	1,451.00	38,741,700
ヤマトインターナショナル	7,500	290.00	2,175,000
東邦ホールディングス	36,200	3,136.00	113,523,200
サンゲツ	36,400	3,120.00	113,568,000
ミツウロコグループホールディングス	18,600	1,387.00	25,798,200
シナネンホールディングス	4,700	4,125.00	19,387,500
伊藤忠エネクス	36,000	1,578.00	56,808,000
サンリオ	41,100	7,237.00	297,440,700
サンワ テクノス	7,400	2,297.00	16,997,800
リョーサン	15,400	4,360.00	67,144,000
新光商事	19,500	1,261.00	24,589,500
トーホー	6,300	3,585.00	22,585,500
三信電気	5,800	2,255.00	13,079,000
東陽テクニカ	14,700	1,339.00	19,683,300
モスフードサービス	21,400	3,345.00	71,583,000
加賀電子	11,800	6,740.00	79,532,000
三益半導体工業	11,000	2,793.00	30,723,000
都築電気	7,200	2,340.00	16,848,000
ソーダニッカ	7,100	1,089.00	7,731,900
立花エレテック	10,500	2,936.00	30,828,000
木曽路	22,000	2,541.00	55,902,000
S R Sホールディングス	24,000	1,066.00	25,584,000
千趣会	26,500	410.00	10,865,000
タカキュー	6,900	93.00	641,700
リテールパートナーズ	21,500	1,747.00	37,560,500
ケーヨー	23,400	871.00	20,381,400
上新電機	12,900	2,340.00	30,186,000
日本瓦斯	76,900	2,312.00	177,792,800
ロイヤルホールディングス	25,600	2,684.00	68,710,400
東天紅	600	850.00	510,000
いなげや	14,100	1,501.00	21,164,100
チヨダ	13,900	959.00	13,330,100
ライフコーポレーション	12,700	3,720.00	47,244,000
リンガーハット	18,700	2,349.00	43,926,300
M r M a x H D	20,200	637.00	12,867,400

テンアライド	11,300	328.00	3,706,400
AOKIホールディングス	26,700	1,052.00	28,088,400
オークワ	23,200	909.00	21,088,800
コメリ	22,300	3,125.00	69,687,500
青山商事	31,000	1,696.00	52,576,000
しまむら	17,000	14,955.00	254,235,000
はせがわ	4,600	353.00	1,623,800
高島屋	109,500	2,207.50	241,721,250
松屋	24,600	1,049.00	25,805,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	70,600	1,823.00	128,703,800
近鉄百貨店	6,300	2,933.00	18,477,900
丸井グループ	107,200	2,614.50	280,274,400
クレディセゾン	85,700	2,489.50	213,350,150
アクシアル リテイリング	9,900	3,795.00	37,570,500
井筒屋	4,600	382.00	1,757,200
イオン	492,400	3,035.00	1,494,434,000
イズミ	22,000	4,014.00	88,308,000
フォーバル	5,600	1,243.00	6,960,800
平和堂	24,300	2,500.00	60,750,000
フジ	22,200	1,825.00	40,515,000
ヤオコー	16,400	7,852.00	128,772,800
ゼビオホールディングス	19,700	1,020.00	20,094,000
ケーズホールディングス	102,700	1,409.50	144,755,650
PALTAC	22,900	4,856.00	111,202,400
三谷産業	25,400	339.00	8,610,600
Olympicグループ	3,500	535.00	1,872,500
日産東京販売ホールディングス	12,300	478.00	5,879,400
あおぞら銀行	85,100	3,194.00	271,809,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,466,500	1,324.50	11,213,879,250
りそなホールディングス	1,697,600	877.40	1,489,474,240
三井住友トラスト・ホールディングス	242,900	6,001.00	1,457,642,900
三井住友フィナンシャルグループ	960,800	7,600.00	7,302,080,000
千葉銀行	376,700	1,154.50	434,900,150
群馬銀行	262,400	743.90	195,199,360
武蔵野銀行	17,300	2,921.00	50,533,300
千葉興業銀行	21,100	921.00	19,433,100
筑波銀行	59,200	290.00	17,168,000
七十七銀行	43,300	3,380.00	146,354,000
秋田銀行	9,100	2,148.00	19,546,800
山形銀行	15,000	1,217.00	18,255,000
岩手銀行	9,200	2,835.00	26,082,000
東邦銀行	106,200	293.00	31,116,600
東北銀行	4,400	1,227.00	5,398,800
ふくおかフィナンシャルグループ	107,900	3,806.00	410,667,400
スルガ銀行	119,200	652.00	77,718,400
八十二銀行	285,500	905.80	258,605,900
山梨中央銀行	13,900	1,723.00	23,949,700
大垣共立銀行	25,700	2,231.00	57,336,700
福井銀行	12,100	1,675.00	20,267,500
清水銀行	5,400	1,709.00	9,228,600



富山銀行	1,400	1,916.00	2,682,400
滋賀銀行	22,400	3,580.00	80,192,000
南都銀行	20,300	2,881.00	58,484,300
百五銀行	127,100	579.00	73,590,900
京都銀行	42,800	8,687.00	371,803,600
紀陽銀行	48,300	1,606.00	77,569,800
ほくほくフィナンシャルグループ	85,900	1,614.50	138,685,550
山陰合同銀行	84,600	1,024.00	86,630,400
鳥取銀行	2,900	1,439.00	4,173,100
百十四銀行	12,300	2,612.00	32,127,600
四国銀行	21,600	1,053.00	22,744,800
阿波銀行	19,000	2,421.00	45,999,000
大分銀行	8,100	2,814.00	22,793,400
宮崎銀行	8,800	2,938.00	25,854,400
佐賀銀行	7,900	2,119.00	16,740,100
琉球銀行	31,100	1,167.00	36,293,700
セブン銀行	484,300	326.00	157,881,800
みずほフィナンシャルグループ	1,955,100	2,683.00	5,245,533,300
高知銀行	3,000	1,139.00	3,417,000
山口フィナンシャルグループ	132,600	1,394.50	184,910,700
芙蓉総合リース	12,400	12,930.00	160,332,000
みずほリース	20,100	5,120.00	102,912,000
東京センチュリー	25,300	6,325.00	160,022,500
SBIホールディングス	195,800	3,356.00	657,104,800
日本証券金融	49,700	1,573.00	78,178,100
アイフル	223,900	369.00	82,619,100
日本アジア投資	7,200	275.00	1,980,000
名古屋銀行	8,900	5,180.00	46,102,000
北洋銀行	204,600	394.00	80,612,400
大光銀行	2,700	1,400.00	3,780,000
愛媛銀行	18,300	1,032.00	18,885,600
トマト銀行	3,000	1,302.00	3,906,000
京葉銀行	61,700	716.00	44,177,200
栃木銀行	61,900	345.00	21,355,500
北日本銀行	4,700	2,452.00	11,524,400
東和銀行	25,000	657.00	16,425,000
福島銀行	9,300	258.00	2,399,400
大東銀行	3,500	756.00	2,646,000
リコーリース	12,800	4,685.00	59,968,000
イオンフィナンシャルサービス	77,600	1,338.00	103,828,800
アコム	241,200	370.60	89,388,720
ジャックス	14,400	5,370.00	77,328,000
オリエントコーポレーション	35,300	1,201.00	42,395,300
オリックス	887,500	2,985.00	2,649,187,500
三菱HCキャピタル	527,100	1,075.00	566,632,500
ジャフコグループ	45,200	1,785.50	80,704,600
九州リースサービス	4,200	922.00	3,872,400
トモニホールディングス	108,900	478.00	52,054,200
大和証券グループ本社	966,700	913.50	883,080,450
野村ホールディングス	2,435,400	652.30	1,588,611,420

岡三証券グループ	118,700	697.00	82,733,900
丸三証券	45,000	650.00	29,250,000
東洋証券	44,900	372.00	16,702,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	147,200	502.00	73,894,400
光世証券	2,000	671.00	1,342,000
水戸証券	36,300	483.00	17,532,900
いちよし証券	24,900	779.00	19,397,100
松井証券	79,700	860.00	68,542,000
SOMPOホールディングス	232,000	6,886.00	1,597,552,000
日本取引所グループ	379,900	2,651.50	1,007,304,850
マネックスグループ	145,700	584.00	85,088,800
極東証券	16,800	910.00	15,288,000
岩井コスモホールディングス	15,400	1,865.00	28,721,000
アイザワ証券グループ	19,500	1,040.00	20,280,000
フィデアホールディングス	14,000	1,708.00	23,912,000
池田泉州ホールディングス	173,300	329.00	57,015,700
アニコムホールディングス	45,900	650.00	29,835,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	275,100	5,803.00	1,596,405,300
マネーパートナーズグループ	9,400	300.00	2,820,000
スパークス・グループ	15,000	1,554.00	23,310,000
小林洋行	2,900	239.00	693,100
第一生命ホールディングス	660,500	3,180.00	2,100,390,000
東京海上ホールディングス	1,336,300	3,585.00	4,790,635,500
アドバンテッジリスクマネジメント	4,300	480.00	2,064,000
イー・ギャランティ	21,900	1,948.00	42,661,200
アサックス	4,300	685.00	2,945,500
NECキャピタルソリューション	6,600	3,490.00	23,034,000
T&Dホールディングス	362,700	2,594.50	941,025,150
アドバンスクリエイト	7,800	1,155.00	9,009,000
三井不動産	576,900	3,450.00	1,990,305,000
三菱地所	815,800	2,079.50	1,696,456,100
平和不動産	21,900	4,255.00	93,184,500
東京建物	118,100	2,180.50	257,517,050
京阪神ビルディング	22,700	1,408.00	31,961,600
住友不動産	244,400	4,085.00	998,374,000
太平洋興発	3,400	820.00	2,788,000
テオーシー	24,400	655.00	15,982,000
東京楽天地	2,200	4,210.00	9,262,000
レオパレス21	152,200	333.00	50,682,600
スターツコーポレーション	19,400	3,085.00	59,849,000
フジ住宅	18,900	769.00	14,534,100
空港施設	16,400	595.00	9,758,000
明和地所	4,300	1,208.00	5,194,400
ゴールドクレスト	12,800	2,208.00	28,262,400
リログループ	78,600	1,649.50	129,650,700
エスリード	6,400	3,255.00	20,832,000
日神グループホールディングス	21,700	558.00	12,108,600
日本エスコン	25,300	953.00	24,110,900

MIRARTHホールディングス	68,200	500.00	34,100,000
AVANTIA	5,100	888.00	4,528,800
イオンモール	70,000	1,836.00	128,520,000
毎日コムネット	3,300	774.00	2,554,200
ファースト住建	3,700	1,231.00	4,554,700
ランド	813,300	9.00	7,319,700
カチタス	36,300	2,237.00	81,203,100
東祥	9,800	1,206.00	11,818,800
トーセイ	22,500	2,031.00	45,697,500
穴吹興産	1,800	2,052.00	3,693,600
サンフロンティア不動産	22,500	1,554.00	34,965,000
FJネクストホールディングス	14,300	1,101.00	15,744,300
インテリックス	2,200	539.00	1,185,800
ランドビジネス	3,300	340.00	1,122,000
サンネクスタグループ	2,600	977.00	2,540,200
グランディハウス	7,600	655.00	4,978,000
東武鉄道	150,700	4,106.00	618,774,200
相鉄ホールディングス	45,300	2,971.00	134,586,300
東急	384,900	1,840.00	708,216,000
京浜急行電鉄	155,700	1,358.00	211,440,600
小田急電鉄	208,100	2,337.00	486,329,700
京王電鉄	72,500	5,343.00	387,367,500
京成電鉄	88,500	5,722.00	506,397,000
富士急行	16,900	5,210.00	88,049,000
東日本旅客鉄道	232,800	8,826.00	2,054,692,800
西日本旅客鉄道	175,300	6,570.00	1,151,721,000
東海旅客鉄道	105,700	19,425.00	2,053,222,500
西武ホールディングス	166,000	1,532.50	254,395,000
鴻池運輸	23,400	2,013.00	47,104,200
西日本鉄道	36,600	2,598.50	95,105,100
ハマキョウレックス	10,700	4,195.00	44,886,500
サカイ引越センター	6,500	5,190.00	33,735,000
近鉄グループホールディングス	137,000	4,441.00	608,417,000
阪急阪神ホールディングス	182,700	5,334.00	974,521,800
南海電気鉄道	65,500	2,980.50	195,222,750
京阪ホールディングス	75,600	4,151.00	313,815,600
神戸電鉄	3,800	3,080.00	11,704,000
名古屋鉄道	151,400	2,372.00	359,120,800
山陽電気鉄道	10,300	2,230.00	22,969,000
アルプス物流	11,000	1,618.00	17,798,000
トランコム	4,000	7,580.00	30,320,000
ヤマトホールディングス	175,500	2,544.50	446,559,750
山九	34,900	5,382.00	187,831,800
日新	10,400	2,874.00	29,889,600
丸運	4,300	268.00	1,152,400
丸全昭和運輸	8,500	4,075.00	34,637,500
センコーグループホールディングス	72,500	1,108.00	80,330,000
トナミホールディングス	3,000	4,965.00	14,895,000
ニッコンホールディングス	43,800	3,374.00	147,781,200
日本石油輸送	900	2,808.00	2,527,200

福山通運	10,400	3,830.00	39,832,000
セイノーホールディングス	77,000	2,151.50	165,665,500
エスライングループ本社	2,500	886.00	2,215,000
神奈川中央交通	3,900	3,325.00	12,967,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	33,100	2,144.00	70,966,400
C & F ロジホールディングス	13,100	1,449.00	18,981,900
日本郵船	366,600	4,382.00	1,606,441,200
商船三井	241,600	4,515.00	1,090,824,000
川崎汽船	103,000	5,560.00	572,680,000
N S ユナイテッド海運	7,400	4,380.00	32,412,000
明治海運	8,900	882.00	7,849,800
飯野海運	50,300	1,133.00	56,989,900
共栄タンカー	1,700	877.00	1,490,900
九州旅客鉄道	96,900	3,258.00	315,700,200
S G ホールディングス	263,000	2,045.00	537,835,000
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	46,500	7,770.00	361,305,000
I D & E ホールディングス	8,500	3,570.00	30,345,000
日本航空	336,600	3,011.00	1,013,502,600
A N A ホールディングス	372,900	3,266.00	1,217,891,400
ビーウィズ	3,500	2,281.00	7,983,500
パスコ	1,800	1,728.00	3,110,400
T R E ホールディングス	29,700	1,266.00	37,600,200
人・夢・技術グループ	5,300	1,755.00	9,301,500
西本W i s m e t t a c ホールディングス	3,700	5,140.00	19,018,000
シルバーライフ	2,800	1,192.00	3,337,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	2,021.00	1,414,700
G e n k y D r u g S t o r e s	6,400	5,410.00	34,624,000
コア商事ホールディングス	8,100	722.00	5,848,200
K P P グループホールディングス	33,800	725.00	24,505,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	1,188.00	1,900,800
ブックオフグループホールディングス	6,400	1,250.00	8,000,000
ギフトホールディングス	6,300	2,393.00	15,075,900
三菱倉庫	29,400	4,126.00	121,304,400
三井倉庫ホールディングス	12,800	4,400.00	56,320,000
住友倉庫	36,900	2,567.00	94,722,300
澁澤倉庫	5,400	3,410.00	18,414,000
ヤマタネ	6,500	2,081.00	13,526,500
東陽倉庫	12,200	296.00	3,611,200
乾汽船	17,400	1,288.00	22,411,200
日本トランスシティ	27,600	699.00	19,292,400
ケイヒン	1,700	1,998.00	3,396,600
中央倉庫	6,700	1,101.00	7,376,700
川西倉庫	1,600	1,121.00	1,793,600
安田倉庫	9,400	1,091.00	10,255,400
ファイズホールディングス	1,700	1,153.00	1,960,100
大栄環境	35,900	2,237.00	80,308,300
日本管財ホールディングス	14,800	2,642.00	39,101,600
東洋埠頭	2,700	1,475.00	3,982,500

上組	65,700	3,244.00	213,130,800
サンリツ	2,100	746.00	1,566,600
キムラユニティー	4,400	1,399.00	6,155,600
キューソー流通システム	4,700	965.00	4,535,500
東海運	5,300	290.00	1,537,000
エーアイティー	8,600	1,786.00	15,359,600
内外トランスライン	5,500	2,585.00	14,217,500
ショーエイコーポレーション	2,500	617.00	1,542,500
日本コンセプト	5,000	1,904.00	9,520,000
TBSホールディングス	70,400	2,645.00	186,208,000
日本テレビホールディングス	121,900	1,413.50	172,305,650
朝日放送グループホールディングス	12,800	702.00	8,985,600
テレビ朝日ホールディングス	33,400	1,736.00	57,982,400
スカパーJ S A Tホールディングス	122,200	744.00	90,916,800
テレビ東京ホールディングス	9,900	3,075.00	30,442,500
日本BS放送	3,300	910.00	3,003,000
ビジョン	20,800	1,550.00	32,240,000
スマートバリュー	2,200	420.00	924,000
USEN - NEXT HOLDING S	15,400	3,330.00	51,282,000
ワイヤレスゲート	3,900	217.00	846,300
日本通信	127,000	220.00	27,940,000
クロップス	1,500	1,110.00	1,665,000
日本電信電話	44,099,500	181.00	7,982,009,500
KDDI	1,063,800	4,730.00	5,031,774,000
ソフトバンク	2,212,700	1,760.00	3,894,352,000
光通信	16,200	23,900.00	387,180,000
エムティーアイ	9,500	614.00	5,833,000
GMOインターネットグループ	50,800	2,451.00	124,510,800
ファイバーゲート	7,400	1,438.00	10,641,200
アйдママーケティングコミュニケーション	2,200	257.00	565,400
KADOKAWA	72,700	3,185.00	231,549,500
学研ホールディングス	22,900	882.00	20,197,800
ゼンリン	23,500	922.00	21,667,000
昭文社ホールディングス	4,000	321.00	1,284,000
インプレスホールディングス	8,000	186.00	1,488,000
東京電力ホールディングス	1,237,300	698.90	864,748,970
中部電力	505,800	2,097.50	1,060,915,500
関西電力	530,000	2,344.00	1,242,320,000
中国電力	218,600	1,039.00	227,125,400
北陸電力	129,500	923.20	119,554,400
東北電力	335,500	1,110.50	372,572,750
四国電力	117,200	1,112.50	130,385,000
九州電力	316,400	1,073.00	339,497,200
北海道電力	132,600	722.50	95,803,500
沖縄電力	32,100	1,246.00	39,996,600
電源開発	103,400	2,584.00	267,185,600
エフオン	8,900	510.00	4,539,000
イーレックス	24,400	847.00	20,666,800

レノバ	36,600	1,254.00	45,896,400
東京瓦斯	290,200	3,562.00	1,033,692,400
大阪瓦斯	278,000	2,565.00	713,070,000
東邦瓦斯	54,100	2,787.50	150,803,750
北海道瓦斯	8,200	2,446.00	20,057,200
広島ガス	29,000	413.00	11,977,000
西部ガスホールディングス	12,800	2,113.00	27,046,400
静岡ガス	27,300	1,073.00	29,292,900
メタウォーター	16,500	1,926.00	31,779,000
アイネット	8,300	1,761.00	14,616,300
松竹	7,800	10,995.00	85,761,000
東宝	86,200	5,443.00	469,186,600
エイチ・アイ・エス	41,000	1,776.00	72,816,000
東映	3,800	20,020.00	76,076,000
ラックランド	6,400	3,030.00	19,392,000
NTTデータグループ	431,900	2,157.00	931,608,300
共立メンテナンス	24,200	6,338.00	153,379,600
イチネンホールディングス	14,900	1,405.00	20,934,500
建設技術研究所	7,300	4,670.00	34,091,000
スペース	9,300	937.00	8,714,100
アインホールディングス	20,000	4,601.00	92,020,000
燦ホールディングス	6,100	2,141.00	13,060,100
ピー・シー・エー	7,900	1,266.00	10,001,400
スバル興業	600	11,920.00	7,152,000
東京テアトル	3,400	1,142.00	3,882,800
タナベコンサルティンググループ	3,700	1,173.00	4,340,100
ビジネスブレイン太田昭和	5,800	2,149.00	12,464,200
ナガワ	3,800	7,160.00	27,208,000
東京都競馬	11,800	3,970.00	46,846,000
常磐興産	3,200	1,363.00	4,361,600
カナモト	21,900	2,638.00	57,772,200
D T S	29,300	3,355.00	98,301,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	69,200	5,301.00	366,829,200
シーイーシー	19,300	1,683.00	32,481,900
カブコン	136,800	5,637.00	771,141,600
ニシオホールディングス	13,100	3,605.00	47,225,500
アイ・エス・ビー	7,000	1,445.00	10,115,000
アゴーラ ホスピタリティグループ	60,800	26.00	1,580,800
日本空港ビルデング	47,800	6,585.00	314,763,000
トランス・コスモス	17,500	3,200.00	56,000,000
乃村工藝社	61,600	894.00	55,070,400
ジャステック	8,500	1,485.00	12,622,500
S C S K	112,400	2,659.50	298,927,800
藤田観光	5,600	5,130.00	28,728,000
K N T - C Tホールディングス	8,500	1,364.00	11,594,000
トーカイ	12,500	1,955.00	24,437,500
白洋舎	1,500	2,584.00	3,876,000
セコム	143,700	10,385.00	1,492,324,500

NSW	5,300	2,888.00	15,306,400
セントラル警備保障	7,600	3,205.00	24,358,000
アイネス	9,700	1,663.00	16,131,100
丹青社	27,400	938.00	25,701,200
メイテック	55,100	2,586.50	142,516,150
TKC	21,900	3,665.00	80,263,500
富士ソフト	27,700	4,800.00	132,960,000
応用地質	13,100	2,563.00	33,575,300
船井総研ホールディングス	29,300	2,744.00	80,399,200
NSD	49,200	2,583.00	127,083,600
進学会ホールディングス	3,100	293.00	908,300
丸紅建材リース	800	2,821.00	2,256,800
オオバ	5,800	943.00	5,469,400
コナミグループ	59,000	8,362.00	493,358,000
いであ	2,500	1,700.00	4,250,000
学究社	5,600	2,065.00	11,564,000
ベネッセホールディングス	52,700	1,884.50	99,313,150
イオンディライト	15,700	3,295.00	51,731,500
ナック	6,100	984.00	6,002,400
福井コンピュータホールディングス	9,600	2,715.00	26,064,000
ダイセキ	28,800	4,270.00	122,976,000
ステップ	5,100	1,777.00	9,062,700
泉州電業	7,300	3,300.00	24,090,000
元気寿司	4,100	5,150.00	21,115,000
トラスコ中山	30,500	2,546.00	77,653,000
ヤマダホールディングス	595,300	467.80	278,481,340
オートバックスセブン	50,500	1,593.50	80,471,750
モリト	10,300	1,375.00	14,162,500
アーケランズ	43,400	1,617.00	70,177,800
ニトリホールディングス	58,800	17,280.00	1,016,064,000
グルメ杵屋	11,800	1,134.00	13,381,200
愛眼	7,300	184.00	1,343,200
ケーユーホールディングス	8,600	1,271.00	10,930,600
吉野家ホールディングス	56,900	2,893.00	164,611,700
加藤産業	17,900	4,265.00	76,343,500
北恵	2,500	908.00	2,270,000
イノテック	9,200	1,650.00	15,180,000
イエローハット	25,600	1,933.00	49,484,800
松屋フーズホールディングス	6,900	4,260.00	29,394,000
JBCホールディングス	10,000	2,773.00	27,730,000
JKホールディングス	11,200	1,011.00	11,323,200
サガミホールディングス	23,300	1,350.00	31,455,000
日伝	8,600	2,628.00	22,600,800
関西フードマーケット	13,100	1,520.00	19,912,000
ミロク情報サービス	12,500	1,612.00	20,150,000
北沢産業	5,100	313.00	1,596,300
杉本商事	6,500	2,290.00	14,885,000
因幡電機産業	37,700	3,335.00	125,729,500
王将フードサービス	9,600	6,990.00	67,104,000
ミニストップ	10,500	1,452.00	15,246,000

アークス	26,600	2,732.00	72,671,200	
パローホールディングス	27,700	2,201.00	60,967,700	
東テク	4,800	5,430.00	26,064,000	
ミスミグループ本社	219,300	2,456.00	538,600,800	
アルテック	5,100	262.00	1,336,200	
ベルク	7,200	6,890.00	49,608,000	
大 庄	5,200	1,152.00	5,990,400	
タキヒヨー	2,400	1,244.00	2,985,600	
ファーストリテイリング	65,300	34,740.00	2,268,522,000	
ソフトバンクグループ	679,000	6,497.00	4,411,463,000	
蔵王産業	1,600	2,621.00	4,193,600	
スズケン	42,600	4,498.00	191,614,800	
サンドラッグ	55,100	4,252.00	234,285,200	
サックスパー ホールディングス	13,800	943.00	13,013,400	
ジェコス	8,700	980.00	8,526,000	
ヤマザワ	1,800	1,287.00	2,316,600	
やまや	2,100	3,100.00	6,510,000	
グローセル	11,600	438.00	5,080,800	
ベルーナ	34,900	750.00	26,175,000	
合計	204,312,100		473,953,844,380	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2023年9月19日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,257,180,229
コール・ローン	2,555,476,537
株式	1,119,487,791,696
投資信託受益証券	1,821,792,866
投資証券	21,159,123,472
派生商品評価勘定	37,020,929
未収入金	320,196,423
未収配当金	1,688,805,940
差入委託証拠金	8,561,940,442
流動資産合計	1,164,889,328,534
資産合計	
1,164,889,328,534	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,290,532
未払解約金	31,896,000
流動負債合計	109,186,532
負債合計	
109,186,532	
純資産の部	
元本等	
元本	158,050,663,273
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,006,729,478,729
元本等合計	1,164,780,142,002
純資産合計	1,164,780,142,002
負債純資産合計	1,164,889,328,534

## 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9月17日 至 2023年9月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年9月19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	126,499,195,964円
同期中追加設定元本額	57,539,779,256円
同期中一部解約元本額	25,988,311,947円

## 元本の内訳

## ファンド名

DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,729,397,576円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,909,129円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,067,544円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	20,409,599円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,413,549円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	24,155,102円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,595,646円
たわらノーロード 先進国株式	51,721,771,194円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	301,218,978円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,896,072,713円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	874,621,627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)	752,595,281円
たわらノーロード バランス(積極型)	987,321,207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)	33,930,054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)	221,415,420円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	231,435,314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)	399,993,492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)	286,487円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	14,006,426円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,615,412円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,207,287円
たわらノーロード 全世界株式	1,022,859,515円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,925,810,761円
One DC 先進国株式インデックスファンド	3,077,502,080円
Oneグローバルバランス	16,302,221円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	145,600,050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	84,508,680円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	244,622,710円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	240,449,722円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,341,713円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	119,662,334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)	309,178,969円
投資のソムリエ	11,701,054,139円
クルーズコントロール	119,273,571円
投資のソムリエ<DC年金>	1,006,627,994円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	186,707,670円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	265,791,096円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,001,489,438円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,688,373,409円
ワールドアセットバランス(基本コース)	126,432,685円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	298,709,886円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	55,532,431円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	28,776,508円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,798,703円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	150,784,965円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	135,618,184円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,255,285,839円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	133,159,332円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	61,241,575円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	30,183,297円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	18,609,544円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	127,982,370円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,370,534円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	36,131,402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 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)	331,094,907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)	35,425,719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)	1,107,889,042円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	197,770,343円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,269,205,410円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	331,604,034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)	5,836,104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)	4,451,661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)	21,291,615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)	43,197,661円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,506,083円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,094,756円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	990,684円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	30,572円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	885,932円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	15,853,523円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	119,439,682円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	211,558,229円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	726,058,087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)	31,295,806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)	28,394,047円

D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	188,286,941円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	5,313,092円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	142,312円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	72,253,752円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,287,199円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	23,540,254円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	35,820,287円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	79,861,679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>	2,608,008,204円
MHAM外国株式インデックスファンド	137,306,449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>	11,898,873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]	1,934,924,664円
計	158,050,663,273円
2. 受益権の総数	158,050,663,273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9月17日 至 2023年9月19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9月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年9月19日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
株式	56,282,100,852	
投資信託受益証券	5,761,078	
投資証券	2,065,989,723	
合計	54,221,872,207	

（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9月19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9月19日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	2,856,232,532	-	2,861,455,749	5,223,217
イギリス・ポンド	2,087,548,000	-	2,089,983,500	2,435,500
カナダ・ドル	145,303,418	-	145,218,348	85,070
ユーロ	88,642,792	-	88,965,724	322,932
ユーロ	534,738,322	-	537,288,177	2,549,855
合計	2,856,232,532	-	2,861,455,749	5,223,217

## （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。

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。

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

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

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表さ

れている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 株式関連

種類	2023年9月19日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	22,693,383,054	-		22,647,890,234	45,492,820
合計	22,693,383,054	-		22,647,890,234	45,492,820

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2023年9月19日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	7.3697円 (73,697円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

（1）株式

2023年9月19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	1,351,065	139.980	189,122,078.700	
	ABBOTT LABORATORIES	254,506	101.000	25,705,106.000	
	AES CORP	90,680	17.080	1,548,814.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	132,594	145.090	19,238,063.460	
	ADVANCED MICRO DEVICES	236,936	102.370	24,255,138.320	
	ADOBE INC	66,769	532.420	35,549,150.980	
	CHUBB LTD	60,826	214.110	13,023,454.860	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	32,782	299.530	9,819,192.460	
	ALLSTATE CORP	40,932	111.040	4,545,089.280	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	97,608	194.460	18,980,851.680	
	AMGEN INC	78,472	263.150	20,649,906.800	

HESS CORP	41,495	162.600	6,747,087.000	
AMERICAN EXPRESS CO	92,629	159.630	14,786,367.270	
AMERICAN ELECTRIC POWER	78,514	80.230	6,299,178.220	
AFLAC INC	83,202	76.920	6,399,897.840	
AMERICAN INTL GROUP	106,358	61.680	6,560,161.440	
ANALOG DEVICES	71,820	179.720	12,907,490.400	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	97,613	57.560	5,618,604.280	
VALERO ENERGY CORP	52,681	146.280	7,706,176.680	
ANSYS INC	13,278	311.920	4,141,673.760	
APPLE INC	2,300,319	177.970	409,387,772.430	
APPLIED MATERIALS INC	124,538	140.270	17,468,945.260	
ALBEMARLE CORP	16,885	181.620	3,066,653.700	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	78,760	79.190	6,237,004.400	
AMEREN CORP	38,938	80.680	3,141,517.840	
ARROW ELECTRONICS INC	9,826	127.260	1,250,456.760	
AUTODESK INC	31,090	213.520	6,638,336.800	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	59,367	247.280	14,680,271.760	
AUTOZONE INC	2,591	2,522.100	6,534,761.100	
AVERY DENNISON CORP	11,542	182.000	2,100,644.000	
BALL CORP	45,691	51.460	2,351,258.860	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	189,002	370.430	70,012,010.860	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	114,977	44.800	5,150,969.600	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	38.730	2,762,882.010	
BECTON DICKINSON & CO	41,860	264.570	11,074,900.200	
AMETEK INC	32,705	152.470	4,986,531.350	
VERIZON COMM INC	618,103	33.530	20,724,993.590	
WR BERKLEY CORP	30,631	65.010	1,991,321.310	
BEST BUY CO INC	29,593	70.640	2,090,449.520	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	367.720	1,110,882.120	
YUM! BRANDS INC	40,964	127.570	5,225,777.480	
FIRSTENERGY CORP	75,630	36.770	2,780,915.100	
BOEING CO	83,974	205.120	17,224,746.880	
ROBERT HALF INC	14,456	74.150	1,071,912.400	
BORGWARNER INC	29,975	40.900	1,225,977.500	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	206,139	53.000	10,925,367.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	87.820	1,513,402.060	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	24,629	141.330	3,480,816.570	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,378	1,134.970	3,833,928.660	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	307,826	58.580	18,032,447.080	
ONEOK INC	63,913	68.190	4,358,227.470	



AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	113.490	1,101,874.410	
UNITED RENTALS INC	9,916	453.620	4,498,095.920	
SEMPRA	88,786	73.510	6,526,658.860	
FEDEX CORP	35,188	249.300	8,772,368.400	
VERISIGN INC	13,302	199.720	2,656,675.440	
AMPHENOL CORP	84,731	86.230	7,306,354.130	
BROWN-FORMAN CORP	43,429	63.340	2,750,792.860	
QUANTA SERVICES INC	20,975	197.700	4,146,757.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.100	417,236.500	
CSX CORP	293,894	31.100	9,140,103.400	
COTERRA ENERGY INC	112,611	27.900	3,141,846.900	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	42.720	1,152,500.160	
CONSTELLATION BRANDS INC	23,956	260.690	6,245,089.640	
CARDINAL HEALTH INC	37,660	88.170	3,320,482.200	
CARLISLE COS INC	7,522	270.290	2,033,121.380	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	15.040	2,232,056.320	
CATERPILLAR INC	75,561	280.940	21,228,107.340	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	135.580	1,712,510.980	
JPMORGAN CHASE & CO	427,279	149.120	63,715,844.480	
CHURCH & DWIGHT CO INC	34,837	95.150	3,314,740.550	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,671	108.440	2,458,443.240	
CINTAS CORP	12,807	514.730	6,592,147.110	
CISCO SYSTEMS INC	596,529	56.110	33,471,242.190	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	13.890	963,563.190	
CLOROX COMPANY	18,305	142.700	2,612,123.500	
COCA-COLA CO/THE	600,280	58.300	34,996,324.000	
COPART INC	124,186	44.430	5,517,583.980	
COGNEX CORP	25,772	44.490	1,146,596.280	
COLGATE-PALMOLIVE CO	112,540	73.850	8,311,079.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	36,790	200.680	7,383,017.200	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,749	329.000	2,878,421.000	
NRG ENERGY, INC.	34,874	39.750	1,386,241.500	
COMCAST CORP-CL A	602,806	45.640	27,512,065.840	
CONAGRA BRANDS INC	71,055	28.720	2,040,699.600	
CONSOLIDATED EDISON INC	53,058	91.570	4,858,521.060	
CMS ENERGY CORP	43,873	57.010	2,501,199.730	
COOPER COS INC	7,281	337.460	2,457,046.260	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	64.420	1,628,602.020	
CORNING INC	115,879	31.570	3,658,300.030	
WOLFSPEED INC	15,684	40.780	639,593.520	
SEALED AIR CORP	17,610	34.430	606,312.300	
HEICO CORP-CL A	9,463	133.590	1,264,162.170	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	10,081	201.960	2,035,958.760	
CUMMINS INC	21,283	238.340	5,072,590.220	

DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	56.810	1,352,418.860	
DR HORTON INC	44,965	113.190	5,089,588.350	
DANAHER CORP	102,778	253.770	26,081,973.060	
MOODY'S CORP	24,454	343.400	8,397,503.600	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,963	70.220	5,334,121.860	
TARGET CORP	68,540	119.340	8,179,563.600	
DEERE & CO	40,217	410.840	16,522,752.280	
MORGAN STANLEY	179,645	88.710	15,936,307.950	
REPUBLIC SERVICES INC	32,288	148.960	4,809,620.480	
COSTAR GROUP INC	57,938	79.720	4,618,817.360	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	526.260	1,961,371.020	
THE WALT DISNEY CO	269,078	85.020	22,877,011.560	
DOLLAR TREE INC	31,988	110.780	3,543,630.640	
DOVER CORP	20,492	143.530	2,941,216.760	
OMNICOM GROUP	31,106	77.440	2,408,848.640	
DTE ENERGY CO	30,474	107.000	3,260,718.000	
DUKE ENERGY CORP	111,102	94.960	10,550,245.920	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,594	149.100	2,623,265.400	
EBAY INC	75,181	43.910	3,301,197.710	
BANK OF AMERICA CORP	1,051,683	28.760	30,246,403.080	
CITIGROUP INC	285,764	42.640	12,184,976.960	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	78.450	1,317,175.500	
EATON CORP PLC	58,580	219.150	12,837,807.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	38,973	236.830	9,229,975.590	
ECOLAB INC	36,605	175.780	6,434,426.900	
REVVITY INC	17,972	111.490	2,003,698.280	
ELECTRONIC ARTS INC	37,893	120.600	4,569,895.800	
SALESFORCE INC	143,045	215.000	30,754,675.000	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	288.980	974,440.560	
EMERSON ELECTRIC CO	83,796	99.610	8,346,919.560	
ATMOS ENERGY CORP	21,185	114.500	2,425,682.500	
ENTERGY CORP	30,815	98.780	3,043,905.700	
EOG RESOURCES INC	85,068	131.880	11,218,767.840	
EQUIFAX INC	18,787	194.950	3,662,525.650	
EQT CORP	51,269	41.190	2,111,770.110	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	33,270	154.200	5,130,234.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,788	117.750	2,683,287.000	
EXXON MOBIL CORP	591,183	117.640	69,546,768.120	
FMC CORP	17,711	73.740	1,306,009.140	
NEXTERA ENERGY INC	296,614	68.240	20,240,939.360	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	429.180	2,322,722.160	
FAIR ISAAC CORP	3,782	903.120	3,415,599.840	
ASSURANT INC	8,276	140.280	1,160,957.280	
FASTENAL CO	86,388	54.910	4,743,565.080	
FIFTH THIRD BANCORP	102,090	27.130	2,769,701.700	
M&T BANK CORP	24,502	126.690	3,104,158.380	

FIRST HORIZON CORP	69,634	11.230	781,989.820	
FISERV INC	90,826	121.200	11,008,111.200	
FORD MOTOR CO	563,883	12.340	6,958,316.220	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	26.130	990,745.080	
FREEMPORT-MCMORAN INC	211,378	40.190	8,495,281.820	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	1,337.480	2,122,580.760	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,633	233.110	7,373,968.630	
DENTSPLY SIRONA INC	33,798	35.540	1,201,180.920	
GENERAL DYNAMICS CORP	33,504	224.330	7,515,952.320	
GENERAL MILLS INC	83,996	66.100	5,552,135.600	
GENUINE PARTS CO	19,809	148.070	2,933,118.630	
GILEAD SCIENCES INC	183,406	75.620	13,869,161.720	
GARTNER INC	11,345	351.830	3,991,511.350	
MCKESSON CORP	19,309	427.290	8,250,542.610	
NVIDIA CORP	361,503	439.660	158,938,408.980	
GRACO INC	23,985	75.720	1,816,144.200	
GENERAL ELECTRIC CO	159,825	116.570	18,630,800.250	
VW GRAINGER INC	6,794	693.810	4,713,745.140	
HALLIBURTON CO	134,861	42.640	5,750,473.040	
MONSTER BEVERAGE CORP	113,115	56.270	6,364,981.050	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	47,748	343.320	16,392,843.360	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,067	175.130	4,915,373.710	
HASBRO INC	21,174	66.010	1,397,695.740	
HENRY SCHEIN INC	17,431	74.060	1,290,939.860	
HEICO CORP	6,878	168.060	1,155,916.680	
HERSHEY FOODS CORP	21,660	212.460	4,601,883.600	
HP INC	124,613	27.320	3,404,427.160	
F5 INC	8,981	160.810	1,444,234.610	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	90.300	1,636,687.500	
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	217.480	1,353,160.560	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	28.280	1,236,260.200	
HOLOGIC INC	34,146	72.000	2,458,512.000	
HOME DEPOT INC	147,230	317.260	46,710,189.800	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	88.600	2,331,863.400	
HORMEL FOODS CORP	46,012	38.220	1,758,578.640	
CENTERPOINT ENERGY INC	94,813	29.150	2,763,798.950	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,776	377.620	1,803,513.120	
HUBBELL INC	7,826	320.190	2,505,806.940	
HUMANA INC	18,137	474.020	8,597,300.740	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,314	194.340	2,393,102.760	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	223,855	10.590	2,370,624.450	
BIOGEN INC	20,763	253.300	5,259,267.900	
IDEX CORP	11,156	212.360	2,369,088.160	
ILLINOIS TOOL WORKS	44,572	237.710	10,595,210.120	

INTUIT INC	41,081	535.010	21,978,745.810	
IDEXX LABORATORIES INC	12,015	450.270	5,409,994.050	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	32,771	203.730	6,676,435.830	
INTEL CORP	612,277	37.990	23,260,403.230	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	35,897	67.400	2,419,457.800	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	34.160	1,508,266.480	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	30.450	1,646,218.350	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12,054	155.190	1,870,660.260	
JABIL CIRCUIT INC	20,200	106.830	2,157,966.000	
INCYTE CORP	29,986	59.510	1,784,466.860	
JOHNSON & JOHNSON	352,297	162.470	57,237,693.590	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	44,033	73.270	3,226,297.910	
KLA CORPORATION	19,899	456.510	9,084,092.490	
DEVON ENERGY CORP	94,351	49.500	4,670,374.500	
KELLOGG CO	40,921	60.160	2,461,807.360	
KEYCORP	143,240	11.370	1,628,638.800	
KIMBERLY-CLARK CORP	49,048	125.120	6,136,885.760	
BLACKROCK INC/NEW YORK	21,997	694.890	15,285,495.330	
KROGER CO	99,244	46.540	4,618,815.760	
LAM RESEARCH CORP	19,336	635.650	12,290,928.400	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	420.060	2,756,013.660	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,551	151.750	2,056,364.250	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	86.840	1,759,378.400	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,415	105.590	2,472,389.850	
LENNAR CORP	36,628	117.040	4,286,941.120	
ELI LILLY & CO	118,221	571.280	67,537,292.880	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	36.090	1,016,150.040	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	106,059	158.440	16,803,987.960	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	42,994	112.690	4,844,993.860	
LOCKHEED MARTIN CORP	32,830	429.860	14,112,303.800	
LOEWS CORP	29,698	64.560	1,917,302.880	
LOWE'S COS INC	85,504	217.720	18,615,930.880	
DOMINION ENERGY INC	122,106	48.630	5,938,014.780	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	40.290	1,627,756.290	
MCCORMICK & CO INC	35,510	79.920	2,837,959.200	
MCDONALD'S CORPORATION	106,984	277.720	29,711,596.480	
S&P GLOBAL INC	48,231	389.520	18,786,939.120	
EVEREST GROUP LTD	6,951	384.370	2,671,755.870	
MARKEL GROUP INC	1,980	1,535.120	3,039,537.600	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	87,575	72.940	6,387,720.500	
MARSH & MCLENNAN COS	71,953	197.730	14,227,266.690	
MASCO CORP	33,476	55.020	1,841,849.520	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,433	428.040	4,037,701.320	
METLIFE INC	95,569	66.300	6,336,224.700	
MEDTRONIC PLC	195,523	82.800	16,189,304.400	
ACTIVISION BLIZZARD INC	115,959	91.910	10,657,791.690	
CVS HEALTH CORP	189,870	70.700	13,423,809.000	
MERCK & CO. INC.	371,760	107.820	40,083,163.200	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	62,344	94.600	5,897,742.400	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	13,267	201.170	2,668,922.390	
MICROSOFT CORP	1,033,274	329.060	340,009,142.440	
MICRON TECH INC	161,628	70.500	11,394,774.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	77,820	77.950	6,066,069.000	
3M CO	82,200	101.040	8,305,488.000	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	92.110	581,306.210	
ENTEGRIS INC	20,987	92.800	1,947,593.600	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	210.570	1,615,914.180	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,288	287.400	6,980,371.200	
ILLUMINA INC	24,078	142.410	3,428,947.980	
XCEL ENERGY INC	80,976	57.990	4,695,798.240	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,755	111.970	1,652,117.350	
NETAPP INC	28,265	76.170	2,152,945.050	
NEWMONT CORP	116,853	40.470	4,729,040.910	
NVR INC	462	6,126.910	2,830,632.420	
NIKE INC-CL B	181,481	95.510	17,333,250.310	
NORDSON CORP	7,548	231.370	1,746,380.760	
NORFOLK SOUTHERN CORP	33,900	204.130	6,920,007.000	
EVERSOURCE ENERGY	56,722	64.290	3,646,657.380	
NISOURCE INC	53,270	27.550	1,467,588.500	
NORTHERN TRUST CORP	33,900	71.760	2,432,664.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,278	440.520	9,373,384.560	
WELLS FARGO & CO	537,513	43.430	23,344,189.590	
NUCOR CORP	36,511	154.670	5,647,156.370	
CHENIERE ENERGY INC	36,495	163.350	5,961,458.250	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	55,081	102.580	5,650,208.980	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	103,911	66.320	6,891,377.520	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,116	409.840	5,785,301.440	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,916	929.350	8,286,084.600	
ORACLE CORP	238,449	112.210	26,756,362.290	

PACCAR INC	75,017	86.290	6,473,216.930	
PTC INC	15,968	143.270	2,287,735.360	
EXELON CORP	144,751	41.490	6,005,718.990	
PARKER HANNIFIN CORP	18,440	395.860	7,299,658.400	
PAYCHEX INC	47,024	116.310	5,469,361.440	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,597	325.320	3,447,416.040	
PPL CORPORATION	102,363	25.670	2,627,658.210	
PEPSICO INC	201,330	179.380	36,114,575.400	
PENTAIR PLC	25,821	67.130	1,733,363.730	
PFIZER INC	827,764	33.640	27,845,980.960	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	37.610	1,233,457.560	
CONOCOPHILLIPS	174,503	124.480	21,722,133.440	
PG&E CORP	280,056	17.300	4,844,968.800	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	33,967	235.280	7,991,755.760	
ALTRIA GROUP INC	261,380	43.350	11,330,823.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	57,518	124.680	7,171,344.240	
BROWN & BROWN INC	35,984	73.330	2,638,706.720	
GARMIN LTD	24,209	107.050	2,591,573.450	
PPG INDUSTRIES INC	33,760	132.490	4,472,862.400	
COSTCO WHOLESALE CORP	64,786	562.720	36,456,377.920	
T ROWE PRICE GROUP INC	31,190	109.050	3,401,269.500	
QUEST DIAGNOSTICS	16,598	125.790	2,087,862.420	
PROCTER & GAMBLE CO	344,912	154.050	53,133,693.600	
PROGRESSIVE CORP	84,678	140.560	11,902,339.680	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	75,293	61.330	4,617,719.690	
PULTE GROUP INC	32,561	76.620	2,494,823.820	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,196	123.300	4,586,266.800	
QUALCOMM INC	163,611	112.750	18,447,140.250	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,105	107.160	3,118,891.800	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	75.300	1,961,188.500	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	7,931	263.650	2,091,008.150	
REGENERON PHARMACEUTICALS	15,883	824.510	13,095,692.330	
REPLIGEN CORP	6,730	162.940	1,096,586.200	
RESMED INC	23,649	146.050	3,453,936.450	
US BANCORP	220,548	34.750	7,664,043.000	
SEAGEN INC	20,184	207.170	4,181,519.280	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,853	80.570	4,580,646.210	
ROSS STORES INC	51,063	117.670	6,008,583.210	
ROLLINS INC	36,205	38.200	1,383,031.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	15,293	499.160	7,633,653.880	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,256	288.730	4,982,324.880	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	31,833	95.920	3,053,421.360	

RPM INTERNATIONAL INC	19,169	95.530	1,831,214.570	
ACCENTURE PLC-CL A	92,215	315.880	29,128,874.200	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	200,861	71.860	14,433,871.460	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,598	208.350	3,458,193.300	
AXON ENTERPRISE INC	10,996	208.180	2,289,147.280	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	33,616	166.850	5,608,829.600	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	89,746	57.260	5,138,855.960	
BOOKING HOLDINGS INC	5,454	3,158.330	17,225,531.820	
SCHLUMBERGER LTD	209,605	61.210	12,829,922.050	
SCHWAB (CHARLES) CORP	222,080	57.860	12,849,548.800	
POOL CORP	5,406	346.580	1,873,611.480	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,080	122.030	3,914,722.400	
BUNGE LTD	21,715	113.930	2,473,989.950	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	61.650	892,507.050	
ELEVANCE HEALTH INC	35,094	442.720	15,536,815.680	
CENCORA INC	23,804	179.030	4,261,630.120	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,327	76.940	2,718,059.380	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	34,934	259.950	9,081,093.300	
CENTENE CORP	78,244	67.860	5,309,637.840	
SMITH (A.O.) CORP	19,467	67.160	1,307,403.720	
SNAP-ON INC	8,453	260.690	2,203,612.570	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	55,325	98.910	5,472,195.750	
EDISON INTERNATIONAL	58,038	71.220	4,133,466.360	
SOUTHERN CO	156,515	70.950	11,104,739.250	
TRUIST FINANCIAL CORP	191,230	28.670	5,482,564.100	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	29.080	572,876.000	
AT&T INC	1,054,734	15.090	15,915,936.060	
CHEVRON CORP	265,143	167.220	44,337,212.460	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,889	87.050	1,992,487.450	
STATE STREET CORP	50,667	71.260	3,610,530.420	
STARBUCKS CORP	169,008	96.760	16,353,214.080	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	98.110	2,250,349.070	
STRYKER CORP	50,212	293.220	14,723,162.640	
NETFLIX INC	65,168	394.400	25,702,259.200	
GEN DIGITAL INC	89,004	19.010	1,691,966.040	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	26,712	53.640	1,432,831.680	
SYNOPSIS INC	22,518	460.010	10,358,505.180	
SYSCO CORP	72,334	70.820	5,122,693.880	
INTUITIVE SURGICAL INC	51,655	298.170	15,401,971.350	
TELEFLEX INC	6,985	211.270	1,475,720.950	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	10.540	1,783,895.000	
TERADYNE INC	22,066	96.760	2,135,106.160	
TEXAS INSTRUMENTS INC	133,210	162.830	21,690,584.300	
TEXTRON INC	29,892	76.130	2,275,677.960	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	56,473	507.730	28,673,036.290	
GLOBE LIFE INC	12,153	110.450	1,342,298.850	
TORO CO	14,644	81.630	1,195,389.720	
DAVITA INC	6,813	99.770	679,733.010	
TRACTOR SUPPLY CO	16,933	209.490	3,547,294.170	
BIO-TECHNE CORP	25,530	71.170	1,816,970.100	
TRIMBLE INC	36,251	52.120	1,889,402.120	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,996	390.160	2,339,399.360	
TYSON FOODS INC	41,316	53.900	2,226,932.400	
MARATHON OIL CORP	99,330	26.900	2,671,977.000	
UNION PACIFIC CORP	89,387	213.150	19,052,839.050	
RTX CORP	215,998	75.180	16,238,729.640	
UNITEDHEALTH GROUP INC	136,458	486.060	66,326,775.480	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	127.430	1,031,673.280	
VF CORP	51,762	17.330	897,035.460	
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	13.600	1,069,816.800	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	38,008	352.000	13,378,816.000	
VULCAN MATERIALS CO	20,250	211.690	4,286,722.500	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,661	22.190	2,388,997.590	
WALMART INC	216,051	163.420	35,307,054.420	
WASTE MANAGEMENT INC	60,047	159.830	9,597,312.010	
WATERS CORP	8,441	273.390	2,307,684.990	
WATSCO INC	4,889	358.600	1,753,195.400	
WEBSTER FINANCIAL CORP	31,618	40.880	1,292,543.840	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,639	394.600	4,198,149.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,386	126.770	1,950,483.220	
VAIL RESORTS INC	5,235	252.650	1,322,622.750	
WESTERN DIGITAL CORP	47,864	43.650	2,089,263.600	
WABTEC CORP	27,784	108.110	3,003,728.240	
WHIRLPOOL CORP	6,832	137.020	936,120.640	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	98.500	2,190,147.500	
WYNN RESORTS LTD	15,379	97.210	1,494,992.590	
NASDAQ INC	47,600	51.020	2,428,552.000	
CME GROUP INC	53,062	206.550	10,959,956.100	
WILLIAMS COS INC	174,840	34.430	6,019,741.200	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	110.380	943,859.380	
LKQ CORP	37,072	50.110	1,857,677.920	
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	52.190	1,772,685.540	



WEC ENERGY GROUP INC	49,589	86.680	4,298,374.520	
CARMAX INC	22,414	82.410	1,847,137.740	
TJX COMPANIES INC	168,936	91.940	15,531,975.840	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,764	253.200	1,965,844.800	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.500	546,171.500	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	46.170	1,086,287.760	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,146	179.770	3,082,336.420	
CBRE GROUP INC	45,160	78.930	3,564,478.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	133,681	17.800	2,379,521.800	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	384.310	1,974,200.470	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,578	463.190	3,046,863.820	
WESTLAKE CORP	6,030	127.130	766,593.900	
T-MOBILE US INC	80,382	140.810	11,318,589.420	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	49.110	2,348,440.200	
MOSAIC CO/THE	48,502	38.080	1,846,956.160	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	227.120	1,106,301.520	
CELANESE CORP	16,553	129.000	2,135,337.000	
DEXCOM INC	55,631	95.295	5,301,356.140	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,428	129.110	2,508,349.080	
EXPEDIA GROUP INC	21,937	105.740	2,319,618.380	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	29,798	81.260	2,421,385.480	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,506	347.080	5,034,742.480	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	20.150	726,085.100	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	82,389	115.890	9,548,061.210	
LIVE NATION	25,515	83.120	2,120,806.800	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,976	1,938.360	7,706,919.360	
TRANSDIGM GROUP INC	8,185	870.090	7,121,686.650	
MASTERCARD INC	123,715	417.130	51,605,237.950	
OWENS CORNING	13,227	137.420	1,817,654.340	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	93.570	1,689,967.770	
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	63.610	1,550,748.190	
FIRST SOLAR INC	14,780	167.740	2,479,197.200	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,337	184.960	3,206,651.520	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,308	244.300	1,785,344.400	
AECOM TECHNOLOGY CORP	17,000	84.720	1,440,240.000	
DELTA AIR LINES INC	21,592	38.890	839,712.880	
INSULET CORP	10,158	170.980	1,736,814.840	
DISCOVER FINANCIAL	35,918	88.470	3,177,665.460	
TE CONNECTIVITY LTD	45,141	126.970	5,731,552.770	
LULULEMON ATHLETICA INC	16,679	382.810	6,384,887.990	

VMWARE INC	34,158	166.150	5,675,351.700	
MERCADOLIBRE INC	6,711	1,383.730	9,286,212.030	
ULTA BEAUTY INC	7,466	407.890	3,045,306.740	
INVESCO LTD	57,267	15.230	872,176.410	
MSCI INC	11,575	533.090	6,170,516.750	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	227,250	96.960	22,034,160.000	
VISA INC	236,580	244.660	57,881,662.800	
KEURIG DR PEPPER INC	130,795	33.650	4,401,251.750	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,490	138.420	3,943,585.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,697	156.340	9,958,388.980	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	64.430	1,042,606.260	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	279,350	17.020	4,754,537.000	
XYLEM INC	33,760	95.480	3,223,404.800	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,537	100.530	3,773,594.610	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,330	212.280	1,343,732.400	
SPLUNK INC	23,372	119.250	2,787,111.000	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	259.370	2,116,977.940	
HCA HEALTHCARE INC	30,371	255.710	7,766,168.410	
VERISK ANALYTICS INC	20,276	246.220	4,992,356.720	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,533	132.360	1,394,147.880	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,298	275.090	2,832,876.820	
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,771	199.290	7,726,672.590	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,741	111.670	2,204,477.470	
TARGA RESOURCES CORP	32,261	85.660	2,763,477.260	
LEAR CORP	9,620	136.510	1,313,226.200	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,261	151.700	2,315,093.700	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,899	55.500	1,936,894.500	
DOLLAR GENERAL CORP	33,372	113.660	3,793,061.520	
FORTINET INC	100,390	60.450	6,068,575.500	
HYATT HOTELS CORP	6,647	106.620	708,703.140	
HORIZON PHARMA PLC	31,608	115.370	3,646,614.960	
TESLA INC	417,667	265.280	110,798,701.760	
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	110.000	1,002,210.000	
ENPHASE ENERGY INC	18,723	117.160	2,193,586.680	
GENERAL MOTORS CO	203,923	33.340	6,798,792.820	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	28.570	1,120,801.100	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	10,655	246.500	2,626,457.500	
APTIV PLC	42,805	101.390	4,339,998.950	
PHILLIPS 66	64,680	122.450	7,920,066.000	

META PLATFORMS INC	323,741	302.550	97,947,839.550	
IQVIA HOLDINGS INC	26,820	209.350	5,614,767.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,714	156.260	3,861,809.640	
SERVICENOW INC	29,969	578.510	17,337,366.190	
PALO ALTO NETWORKS INC	45,302	239.890	10,867,496.780	
WORKDAY INC	29,552	244.330	7,220,440.160	
ABBVIE INC	258,409	153.940	39,779,481.460	
ZOETIS INC	68,031	179.650	12,221,769.150	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	19.920	1,079,883.120	
CDW CORP	20,506	208.690	4,279,397.140	
HOWMET AEROSPACE INC	55,049	47.090	2,592,257.410	
TWILIO INC	25,710	60.860	1,564,710.600	
SNAP INC	152,250	8.890	1,353,502.500	
TRADE DESK INC A	66,653	80.710	5,379,563.630	
OKTA INC	21,831	83.160	1,815,465.960	
BAKER HUGHES CO	146,676	36.460	5,347,806.960	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,514	99.100	2,132,037.400	
BROADCOM INC	60,431	850.000	51,366,350.000	
ARES MANAGEMENT CORP	23,111	105.350	2,434,743.850	
MONGODB INC	10,029	356.540	3,575,739.660	
BURLINGTON STORES INC	8,453	139.510	1,179,278.030	
VEEVA SYSTEMS INC	20,611	208.190	4,291,004.090	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	37.930	945,898.340	
EVERGY INC	33,192	54.140	1,797,014.880	
ALLEGION PLC	13,423	105.180	1,411,831.140	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	22,274	72.340	1,611,301.160	
STERIS PLC	14,147	228.080	3,226,647.760	
DOCUSIGN INC	26,362	43.760	1,153,601.120	
WIX.COM LTD	8,997	94.700	852,015.900	
DROPBOX INC	45,227	26.570	1,201,681.390	
KKR & CO INC	89,965	64.460	5,799,143.900	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	58.990	297,899.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	70.630	2,391,319.910	
MODERNA INC	47,242	104.140	4,919,781.880	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	37,524	153.360	5,754,680.640	
ARAMARK	42,352	37.340	1,581,423.680	
CIGNA GROUP	42,565	285.340	12,145,497.100	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,670	69.150	2,674,030.500	
DOW INC	101,691	53.380	5,428,265.580	
OVINTIV INC	39,779	47.260	1,879,955.540	
AMCOR PLC	226,283	9.280	2,099,906.240	
PINTEREST INC	79,624	25.400	2,022,449.600	
FOX CORP-A	36,501	31.790	1,160,366.790	
FOX CORP-B	28,295	29.170	825,365.150	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	7.330	312,155.380	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	34,066	166.970	5,688,000.020	

CHEWY INC	9,648	19.200	185,241.600	
AVANTOR INC	97,157	21.420	2,081,102.940	
DYNATRACE INC	32,648	46.910	1,531,517.680	
CLOUDFLARE INC	39,882	61.720	2,461,517.040	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	84.030	1,159,614.000	
CARRIER GLOBAL CORP	119,861	54.390	6,519,239.790	
OTIS WORLDWIDE CORP	59,624	81.390	4,852,797.360	
UBER TECHNOLOGIES INC	268,284	46.510	12,477,888.840	
CORTEVA INC	102,288	51.870	5,305,678.560	
MATCH GROUP INC	42,058	42.810	1,800,502.980	
FERGUSON PLC	29,638	153.740	4,556,546.120	
BILL HOLDINGS INC	14,365	106.540	1,530,447.100	
BLACKSTONE INC	104,245	114.370	11,922,500.650	
PAYLOCITY HOLDING CORP	7,378	188.780	1,392,818.840	
CARLYLE GROUP INC	34,847	32.980	1,149,254.060	
DATADOG INC	35,218	94.500	3,328,101.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	64.230	1,650,004.470	
INGERSOLL RAND INC	58,584	66.390	3,889,391.760	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	58,669	66.280	3,888,581.320	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,050	276.100	2,222,605.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	23.710	2,215,130.460	
DRAFTKINGS INC	66,093	31.250	2,065,406.250	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	33.450	1,031,564.550	
AON PLC	30,014	339.320	10,184,350.480	
WARNER BROS DISCOVERY INC	349,733	11.660	4,077,886.780	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,819.590	1,648,548.540	
BENTLEY SYSTEMS INC	33,976	50.020	1,699,479.520	
COINBASE GLOBAL INC	23,696	81.610	1,933,830.560	
UIPATH INC	53,439	17.410	930,372.990	
AIRBNB INC	59,401	142.550	8,467,612.550	
CONSTELLATION ENERGY CORP	44,942	110.740	4,976,877.080	
MONDAY.COM LTD	3,043	161.990	492,935.570	
ROYALTY PHARMA PLC	63,167	27.980	1,767,412.660	
ROBLOX CORP	59,573	27.610	1,644,810.530	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	17.030	713,625.120	
VIATRIS INC	186,021	9.820	1,826,726.220	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	33,177	50.980	1,691,363.460	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	85.280	1,351,346.880	
HF SINCLAIR CORP	20,299	60.350	1,225,044.650	
SNOWFLAKE INC	39,148	161.450	6,320,444.600	
DOORDASH INC	37,045	80.920	2,997,681.400	
ARISTA NETWORKS INC	39,331	186.020	7,316,352.620	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	55,400	92.060	5,100,124.000	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	38.400	610,291.200	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	254,570	15.460	3,935,652.200	
FNF GROUP	38,907	42.790	1,664,830.530	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,941	133.220	2,523,320.020	
MARVELL TECHNOLOGY INC	128,868	54.780	7,059,389.040	
APA CORP	40,946	42.710	1,748,803.660	
CONFLUENT INC	27,524	32.680	899,484.320	
LINDE PLC	71,507	387.530	27,711,107.710	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	10.600	779,799.600	
LUCID GROUP INC	143,927	5.640	811,748.280	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	54.760	656,079.560	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	198.850	739,920.850	
TOAST INC	45,399	20.390	925,685.610	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.530	986,687.950	
CATALENT INC	27,357	47.190	1,290,976.830	
SYNCHRONY FINANCIAL	65,868	32.140	2,116,997.520	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	19,871	22.640	449,879.440	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE	28,191	68.220	1,923,190.020	
KENVUE INC	218,684	21.080	4,609,858.720	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	71,856	27.400	1,968,854.400	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	170.950	895,265.150	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,504	132.750	3,385,656.000	
HUBSPOT INC	6,653	510.340	3,395,292.020	
QORVO INC	14,144	96.870	1,370,129.280	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,513	92.950	1,720,783.350	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	7,789	136.220	1,061,017.580	
GODADDY INC	19,713	75.250	1,483,403.250	
ETSY INC	18,558	63.850	1,184,928.300	
TRANSUNION	30,143	78.180	2,356,579.740	
ALBERTSONS COS INC	40,041	23.430	938,160.630	
BLOCK INC	78,232	51.250	4,009,390.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	68,003	74.780	5,085,264.340	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,108	63.170	1,965,092.360	
WESTROCK CO	34,286	36.540	1,252,810.440	
KRAFT HEINZ CO	131,176	33.420	4,383,901.920	
FORTIVE CORP	49,865	76.460	3,812,677.900	
WASTE CONNECTIONS INC	37,438	141.480	5,296,728.240	
ALPHABET INC-CL A	871,690	138.210	120,476,274.900	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	188,508	17.000	3,204,636.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	157,222	62.940	9,895,552.680	
	SEA LTD ADR	50,316	38.280	1,926,096.480	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,768	29.180	1,656,490.240	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	47.150	1,054,934.100	
	ALPHABET INC-CL C	770,953	138.960	107,131,628.880	
	ZSCALER INC	12,304	154.720	1,903,674.880	
	ATLASSIAN CORP PLC	21,763	204.880	4,458,803.440	
	ROKU INC	15,660	74.390	1,164,947.400	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,305	455.730	6,519,217.650	
	VISTRA CORP	49,633	33.490	1,662,209.170	
アメリカ・ドル	小計	49,953,183		5,642,903,088.480 (833,626,073,256)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	14.550	891,842.250	
	ASHTAD GROUP	63,076	52.320	3,300,136.320	
	SEVERN TRENT PLC	40,719	24.470	996,393.930	
	BARCLAYS PLC	2,207,571	1.588	3,505,622.740	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.469	555,031.920	
	BT GROUP PLC	904,198	1.182	1,068,762.030	
	BUNZL PLC	46,691	28.730	1,341,432.430	
	AVIVA PLC	416,763	3.964	1,652,048.530	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	49.470	1,017,746.310	
	DIAGEO PLC	323,409	31.500	10,187,383.500	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.066	448,748.150	
	DCC PLC	16,599	45.350	752,764.650	
	NATIONAL GRID PLC	554,398	10.180	5,643,771.640	
	KINGFISHER PLC	323,222	2.356	761,511.030	
	BAE SYSTEMS PLC	461,350	10.550	4,867,242.500	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	314,682	26.980	8,490,120.360	
	HALMA PLC	51,066	21.100	1,077,492.600	
	NEXT PLC	16,093	71.120	1,144,534.160	
	IMPERIAL BRANDS PLC	125,526	17.585	2,207,374.710	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	17.080	341,190.080	
	ANGLO AMERICAN PLC	193,855	22.680	4,396,631.400	
	COMPASS GROUP PLC	252,081	20.590	5,190,347.790	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,899,996	6.230	18,066,975.080	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.249	1,926,041.350	
	CENTRICA PLC	793,776	1.700	1,349,419.200	
	UNILEVER PLC	369,686	41.030	15,168,216.580	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	9.752	883,228.880	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	53,779	20.580	1,106,771.820	
	PEARSON PLC	84,159	8.808	741,272.470	

PERSIMMON PLC	56,474	10.295	581,399.830	
PRUDENTIAL PLC	399,036	9.142	3,647,987.110	
RIO TINTO PLC	165,648	52.380	8,676,642.240	
VODAFONE GROUP PLC	3,279,277	0.794	2,603,745.930	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	103,199	58.300	6,016,501.700	
RELX PLC	279,716	27.880	7,798,482.080	
RENTOKIL INITIAL PLC	363,315	5.976	2,171,170.440	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,235,225	2.244	2,771,844.900	
NATWEST GROUP PLC	905,992	2.320	2,101,901.440	
ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	8.356	744,369.190	
SSE PLC	158,403	16.550	2,621,569.650	
BP PLC	2,547,440	5.192	13,226,308.480	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	10.205	1,553,160.180	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.745	865,632.770	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	98.240	1,056,178.240	
STANDARD CHARTERED PLC	353,135	7.372	2,603,311.220	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,257,724	0.421	3,897,501.800	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.157	659,331.490	
TESCO PLC	1,032,016	2.715	2,801,923.440	
3I GROUP PLC	143,794	20.470	2,943,463.180	
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	10.485	1,320,376.050	
GSK PLC	580,157	15.054	8,733,683.470	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	57,829	83.900	4,851,853.100	
WPP PLC	142,785	7.526	1,074,599.910	
ASTRAZENECA PLC	227,382	107.280	24,393,540.960	
WHITBREAD PLC	25,470	36.280	924,051.600	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.240	984,572.160	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	21.520	1,123,968.080	
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,654	62.240	1,658,944.960	
SAINSBURY (J) PLC	283,091	2.762	781,897.340	
ADMIRAL GROUP PLC	32,350	24.290	785,781.500	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	40.850	673,575.650	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	21.000	387,555.000	
ABRDN PLC	285,831	1.573	449,612.160	
EXPERIAN PLC	130,915	27.680	3,623,727.200	
MONDI PLC	74,310	13.805	1,025,849.550	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.650	282,606.300	
OCADO GROUP PLC	69,766	7.870	549,058.420	
INFORMA PLC	186,195	7.498	1,396,090.110	
GLENCORE PLC	1,536,888	4.596	7,063,537.240	
ENTAIN PLC	96,924	11.145	1,080,217.980	
COCA-COLA HBC AG	31,035	22.750	706,046.250	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	170,421	5.264	897,096.140	

	M&G PLC	270,401	1.985	536,745.980	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	16.340	458,745.500	
	WISE PLC	96,207	7.024	675,757.960	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.360	519,616.560	
	HALEON PLC	848,393	3.276	2,779,335.460	
	SHELL PLC	978,631	25.910	25,356,329.210	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	6.006	859,987.120	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	221,854	5.004	1,110,157.410	
イギリス・ポンド 小計		40,150,227		265,487,396.050 (48,565,609,359)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	187,404	31.930	5,983,809.720	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	228,914	30.630	7,011,635.820	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	760.000	2,530,800.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	19.700	3,209,996.800	
	ICL GROUP LTD	103,067	21.640	2,230,369.880	
	NICE LTD	9,053	689.300	6,240,232.900	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	26,490	128.200	3,396,018.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	200.800	938,137.600	
イスラエル・シュケル 小計		725,874		31,541,000.720 (1,220,163,613)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	51.320	1,452,663.920	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	502,599	21.790	10,951,632.210	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	234,609	21.200	4,973,710.800	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.880	2,327,429.640	
	ASX LTD	31,066	56.590	1,758,024.940	
	BHP GROUP LTD	743,656	45.760	34,029,698.560	
	AMPOL LTD	31,828	33.370	1,062,100.360	
	COMPUTERSHARE LT	96,072	26.010	2,498,832.720	
	CSL LIMITED	71,626	265.670	19,028,879.420	
	REA GROUP LTD	6,134	158.200	970,398.800	
	TRANSURBAN GROUP	450,346	13.230	5,958,077.580	
	COCHLEAR LTD	10,426	258.540	2,695,538.040	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	8.670	2,234,189.640	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	241,047	102.630	24,738,653.610	
	RIO TINTO LIMITED	54,047	119.310	6,448,347.570	
	APA GROUP	164,300	8.600	1,412,980.000	
	ARISTOCRAT LEISU	89,945	40.800	3,669,756.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.760	2,074,072.320	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	42.810	2,601,435.270	
	IGO LTD	91,947	13.150	1,209,103.050	
ORICA LTD	63,862	15.660	1,000,078.920		
LEND LEASE CORP LTD	107,181	7.380	790,995.780		



	BLUESCOPE STEEL LTD	75,503	18.820	1,420,966.460	
	MACQUARIE GROUP LTD	55,525	172.330	9,568,623.250	
	SUNCORP GROUP LTD	199,708	13.960	2,787,923.680	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	447,363	29.580	13,232,997.540	
	NEWCREST MINING LTD	126,686	26.240	3,324,240.640	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.510	620,751.090	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	215,572	15.110	3,257,292.920	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	11.350	1,845,839.150	
	REECE LTD	31,558	18.700	590,134.600	
	SANTOS LTD	485,603	7.780	3,777,991.340	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	31.000	2,011,807.000	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	33.920	881,411.200	
	WESFARMERS LTD	172,065	53.230	9,159,019.950	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	280,336	37.840	10,607,914.240	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	169,400	37.790	6,401,626.000	
	SEEK LTD	69,120	21.780	1,505,433.600	
	MINERAL RESOURCES LTD	28,198	70.480	1,987,395.040	
	BRAMBLES LTD	215,449	14.720	3,171,409.280	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	4.350	1,759,557.600	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.640	811,170.360	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	87,104	11.690	1,018,245.760	
	XERO LTD	23,467	118.200	2,773,799.400	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	24.340	1,093,425.820	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.730	1,377,707.100	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.410	1,263,992.400	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	430,039	25.750	11,073,504.250	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.470	1,432,245.970	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	3.390	2,022,792.660	
	COLES GROUP LTD	203,490	15.820	3,219,211.800	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	67.460	1,437,572.600	
	オーストラリア・ドル 小計	10,207,680		239,322,601.850 (22,750,006,532)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	67,555	67.150	4,536,318.250	
	BARRICK GOLD CORP	239,565	22.520	5,395,003.800	
	BANK OF MONTREAL	106,367	119.300	12,689,583.100	
	BANK OF NOVA SCOTIA	177,412	65.380	11,599,196.560	
	NATIONAL BANK OF CANADA	53,200	95.040	5,056,128.000	
	BCE INC	14,197	55.040	781,402.880	
	BROOKFIELD CORP	204,437	48.460	9,907,017.020	
	SAPUTO INC	34,582	28.960	1,001,494.720	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	9.610	887,108.710	

DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	102.020	1,174,046.160	
CGI INC	31,363	139.500	4,375,138.500	
CCL INDUSTRIES INC	21,058	57.510	1,211,045.580	
CAE INC	40,808	33.340	1,360,538.720	
CAMECO CORP	66,371	54.540	3,619,874.340	
ROGERS COMM-CL B	53,428	56.510	3,019,216.280	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	131,160	55.220	7,242,655.200	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,465	87.200	14,341,348.000	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,857	153.930	1,363,358.010	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	31.630	516,517.900	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	80,815	156.170	12,620,878.550	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	37.980	824,659.740	
OPEN TEXT CORP	40,459	52.400	2,120,051.600	
EMPIRE CO LTD	20,608	37.230	767,235.840	
KINROSS GOLD CORP	193,561	7.070	1,368,476.270	
RB GLOBAL INC	26,641	88.500	2,357,728.500	
FORTIS INC	71,759	56.370	4,045,054.830	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	35.580	3,039,279.180	
TELUS CORP	31,890	23.180	739,210.200	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	40.950	1,400,817.600	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	79.270	2,159,790.420	
ENBRIDGE INC	290,277	47.250	13,715,588.250	
IGM FINANCIAL INC	12,478	37.960	473,664.880	
MANULIFE FINANCIAL CORP	265,111	26.120	6,924,699.320	
LOBLAW CO LTD	25,863	115.570	2,988,986.910	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	112,792	72.740	8,204,490.080	
MAGNA INTERNATIONAL INC	41,868	75.890	3,177,362.520	
SUN LIFE FINANCIAL INC	81,434	68.100	5,545,655.400	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,229	1,141.000	3,684,289.000	
METRO INC	36,555	72.670	2,656,451.850	
EMERA INC	36,998	52.100	1,927,595.800	
ONEX CORP	10,157	82.390	836,835.230	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	22.550	1,248,661.150	
POWER CORP OF CANADA	87,955	38.550	3,390,665.250	
QUEBECOR INC-B	17,195	29.880	513,786.600	
ROYAL BANK OF CANADA	203,332	123.350	25,081,002.200	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	134,233	106.810	14,337,426.730	
STANTEC INC	20,698	90.750	1,878,343.500	
SUNCOR ENERGY INC	195,839	47.060	9,216,183.340	
LUNDIN MINING CORP	77,139	10.290	793,760.310	
TECK RESOURCES LTD-CL B	66,934	58.430	3,910,953.620	
THOMSON REUTERS CORP	22,378	175.780	3,933,604.840	

TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,698	113.430	1,553,764.140		
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	271,064	83.850	22,728,716.400		
TC ENERGY CORP	148,310	50.270	7,455,543.700		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	98.830	800,720.660		
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	155.390	1,528,882.210		
INTACT FINANCIAL CORP	27,665	199.830	5,528,296.950		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	69,100	60.010	4,146,691.000		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,968	2,844.050	8,441,140.400		
FRANCO-NEVADA CORP NPR	30,798	194.360	5,985,899.280		
TOURMALINE OIL CORP	46,466	69.840	3,245,185.440		
KEYERA CORP	39,467	33.220	1,311,093.740		
PARKLAND CORP	15,665	39.500	618,767.500		
ALTAGAS LTD	33,833	27.250	921,949.250		
PEMBINA PIPELINE CORP	81,652	41.780	3,411,420.560		
DOLLARAMA INC	41,354	95.970	3,968,743.380		
CENOVUS ENERGY INC W/I	202,950	27.870	5,656,216.500		
ARC RESOURCES LTD	78,639	21.470	1,688,379.330		
NORTHLAND POWER INC	34,152	23.920	816,915.840		
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	19.870	1,018,198.410		
TMX GROUP LTD	35,200	29.800	1,048,960.000		
BRP INC	4,307	103.400	445,343.800		
IVANHOE MINES LTD	98,820	12.090	1,194,733.800		
NUTRIEN LTD	71,801	84.520	6,068,620.520		
TFI INTERNATIONAL INC	11,591	179.190	2,076,991.290		
WSP GLOBAL INC	17,782	193.750	3,445,262.500		
IA FINANCIAL CORP INC	16,448	87.910	1,445,943.680		
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	46.090	1,643,892.030		
NUVEI CORP	7,929	22.650	179,591.850		
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	37.760	608,049.280		
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	48.430	2,530,419.070		
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	2,968	0.060	178.080		
AIR CANADA	41,444	20.230	838,412.120		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	41,208	94.240	3,883,441.920		
SHOPIFY INC	177,942	80.310	14,290,522.020		
FIRSTSERVICE CORP	5,237	212.260	1,111,605.620		
HYDRO ONE LTD	46,225	37.140	1,716,796.500		
カナダ・ドル 小計	5,857,019		359,315,470.010 (39,373,789,204)		
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	314,100	3.890	1,221,849.000	

	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	5.200	843,440.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	259,510	34.230	8,883,027.300	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	112,300	6.780	761,394.000	
	SEATRIUM LTD	7,235,222	0.138	998,460.630	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	31.800	492,900.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	161,700	9.930	1,605,681.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.870	662,237.910	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.900	1,275,810.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	459,198	12.790	5,873,142.420	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,092,930	2.410	2,633,961.300	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.800	1,659,200.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	183,066	28.900	5,290,607.400	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.530	284,708.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.770	974,545.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	431,290	3.180	1,371,502.200	
	シンガポール・ドル 小計	11,919,209		34,832,466.160 (3,772,704,410)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	64.180	1,523,248.120	
	NESTLE SA-REGISTERED	392,550	105.720	41,500,386.000	
	CIE FINANC RICHEMONT	77,378	119.850	9,273,753.300	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	102,775	257.950	26,510,811.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	189.300	1,005,372.300	
	SIKA INHABER	21,046	240.700	5,065,772.200	
	SGS SA-REG	23,250	81.300	1,890,225.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	299,806	92.020	27,588,148.120	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	145.400	847,682.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,459.000	671,140.000	
	CLARIANT AG-REG	44,162	14.570	643,440.340	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	548.200	1,880,874.200	
	ABB LTD	234,914	33.030	7,759,209.420	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	37.570	745,463.940	
	GEBERIT AG	5,181	452.700	2,345,438.700	
	LONZA GROUP AG-REG	10,781	424.300	4,574,378.300	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,370.000	1,420,690.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	101,800.000	1,628,800.000	
	GIVAUDAN-REG	1,404	2,843.000	3,991,572.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	21,465	426.300	9,150,529.500	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	278.200	1,338,142.000	
	HOLCIM LTD	79,736	58.340	4,651,798.240	
	TEMENOS GROUP	7,082	65.380	463,021.160	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	69.850	326,409.050	
	SONOVA HOLDING AG	8,301	218.900	1,817,088.900	

	KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	267.100	2,107,419.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,536	126.900	2,098,418.400	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,157	242.900	1,009,735.300	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	46.300	428,691.700	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	135.000	662,310.000	
	SCHINDLER NAMEN	4,276	181.200	774,811.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,593	569.800	2,617,091.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	95.850	469,952.550	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	645.000	522,450.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,636	85.150	1,161,105.400	
	DUFREY GROUP	12,933	37.290	482,271.570	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,369	1,029.500	3,468,385.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,111	59.100	1,897,760.100	
	SWISS RE LTD	41,653	93.680	3,902,053.040	
	BKW AG	3,194	163.300	521,580.200	
	SIG GROUP AG	38,322	23.100	885,238.200	
	ALCON INC	72,016	72.800	5,242,764.800	
	UBS GROUP AG	485,141	23.410	11,357,150.810	
	VAT GROUP AG	4,053	327.000	1,325,331.000	
スイス・フラン	小計	2,161,833		199,547,914.210 (32,857,559,554)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	382,550	148.700	56,885,185.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	231,547	128.200	29,684,325.400	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	56.560	23,642,080.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	202.000	5,202,510.000	
	LUNDBERGS B	14,161	462.100	6,543,798.100	
	SKF AB-B SHS	46,594	185.950	8,664,154.300	
	SANDVIK AB	150,884	207.600	31,323,518.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	128.900	28,660,657.200	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	177.900	7,816,392.300	
	SWEDBANK AB	130,971	197.300	25,840,578.300	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,465	148.550	13,735,675.750	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	216,734	95.020	20,594,064.680	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	232.400	5,623,615.200	
	VOLVO AB-B SHS	221,062	230.350	50,921,631.700	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	425.400	4,314,406.800	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	80.580	5,451,559.320	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	294.000	4,495,848.000	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	293.600	6,261,020.000	
	SAAB AB-B	11,789	617.600	7,280,886.400	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	85.120	6,476,355.200	
	INVESTOR AB-B SHS	246,861	214.300	52,902,312.300	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	110,008	158.760	17,464,870.080	
	ASSA ABLOY AB-B	156,585	239.700	37,533,424.500	

	TELIA CO AB	344,810	22.630	7,803,050.300	
	BOLIDEN AB	36,260	306.750	11,122,755.000	
	ALFA LAVAL AB	44,259	371.900	16,459,922.100	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	51.120	3,728,795.040	
	INDUTRADE AB	39,178	212.500	8,325,325.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	86.300	4,122,464.700	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	73.400	15,621,868.800	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	41,104	220.400	9,059,321.600	
	HEXAGON AB-B SHS	303,304	96.020	29,123,250.080	
	SAGAX AB	28,022	220.000	6,164,840.000	
	EPIROC AB-A	105,168	215.000	22,611,120.000	
	EPIROC AB-B	61,487	181.600	11,166,039.200	
	ESSITY AB-B	86,900	242.400	21,064,560.000	
	EQT AB	55,194	204.700	11,298,211.800	
	VOLVO CAR AB	63,710	40.580	2,585,351.800	
	BEIJER REF AB	50,493	120.900	6,104,603.700	
	LIFCO AB	39,479	198.050	7,818,815.950	
	EVOLUTION AB	25,280	1,196.200	30,239,936.000	
	NORDEA BANK ABP	457,613	120.820	55,288,802.660	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	195.050	5,390,791.900	
スウェーデン・クローナ 小計		5,080,389		742,418,694.560 (9,844,471,890)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	14,635	945.400	13,835,929.000	
	A P MOLLER A/S	663	12,445.000	8,251,035.000	
	AP MOLLER MAERSK A	520	12,240.000	6,364,800.000	
	DANSKE BANK A/S	101,212	156.900	15,880,162.800	
	GENMAB A/S	9,624	2,603.000	25,051,272.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	296.500	8,834,217.500	
	ROCKWOOL AS	873	1,644.500	1,435,648.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	479,420	650.400	311,814,768.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	140,190	156.100	21,883,659.000	
	COLOPLAST-B	17,884	773.200	13,827,908.800	
	DSV A/S	28,615	1,318.500	37,728,877.500	
	DEMANT A/S	11,367	309.800	3,521,496.600	
	TRYG A/S	44,887	135.250	6,070,966.750	
	PANDORA A/S	12,473	737.600	9,200,084.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	16,295	451.300	7,353,933.500	
ORSTED A/S	26,911	407.200	10,958,159.200		
デンマーク・クローネ 小計		935,364		502,012,918.950 (10,632,633,623)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.850	1,290,076.850	
	EBOS GROUP LTD	25,631	35.100	899,648.100	
	FISHER & PAYKEL	78,460	21.750	1,706,505.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	4.860	1,064,524.680	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.160	387,057.440	

	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.380	1,287,477.040	
ニュージーランド・ドル 小計		789,612		6,635,289.110 (579,990,621)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	196.100	11,055,137.500	
	NORSK HYDRO ASA	210,898	61.940	13,063,022.120	
	TELENOR ASA	117,313	121.200	14,218,335.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	469.000	5,245,765.000	
	ORKLA ASA	116,068	83.300	9,668,464.400	
	EQUINOR ASA	132,805	354.450	47,072,732.250	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	405.300	8,038,720.200	
	AKER BP ASA	50,741	304.700	15,460,782.700	
	SALMAR ASA	7,248	562.400	4,076,275.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	165.500	4,256,825.500	
	ADEVINTA ASA	24,382	78.200	1,906,672.400	
	DNB BANK ASA	139,232	218.400	30,408,268.800	
ノルウェー・クローネ 小計		911,802		164,471,001.670 (2,249,963,303)	
ユーロ	CRH PLC	102,020	49.600	5,060,192.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	25,007	170.700	4,268,694.900	
	KERRY GROUP PLC-A	25,925	81.340	2,108,739.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	71.600	1,565,176.000	
	UMICORE	34,853	23.140	806,498.420	
	AIR LIQUIDE	76,746	164.340	12,612,437.640	
	AIRBUS SE	87,326	130.040	11,355,873.040	
	AXA SA	260,350	29.065	7,567,072.750	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	99,848	29.270	2,922,550.960	
	ADIDAS AG	24,800	169.600	4,206,080.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	19.660	2,843,091.580	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	183.500	572,520.000	
	DANONE	97,762	53.810	5,260,573.220	
	SAFRAN SA	48,802	151.700	7,403,263.400	
	INTESA SANPAOLO	2,324,879	2.430	5,649,455.970	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	44,654	96.780	4,321,614.120	
	ACCOR SA	29,321	33.990	996,620.790	
	BOUYGUES	29,123	33.300	969,795.900	
	BNP PARIBAS	157,769	60.110	9,483,494.590	
	THALES SA	15,023	138.950	2,087,445.850	
	CAPGEMINI SA	24,999	165.950	4,148,584.050	
	LOTUS BAKERIES NV	84	7,390.000	620,760.000	
	UNICREDIT SPA	266,042	21.645	5,758,479.090	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,755	89.760	1,144,888.800	
	D'IETEREN TRDG	2,736	159.500	436,392.000	
	COMMERZBANK AG	141,036	9.734	1,372,844.420	
EIFFAGE	11,784	92.040	1,084,599.360		

FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	30.120	1,771,477.680	
PUBLICIS GROUPE	33,221	71.880	2,387,925.480	
IBERDROLA SA	891,893	11.055	9,859,877.110	
ENI SPA	334,555	14.974	5,009,626.570	
JERONIMO MARTINS	45,606	21.400	975,968.400	
KESKO OYJ-B	35,252	17.665	622,726.580	
KBC GROUPE	35,962	59.100	2,125,354.200	
HANNOVER RUECK SE	8,405	212.700	1,787,743.500	
WARTSILA OYJ	77,148	11.120	857,885.760	
L'OREAL	35,467	404.400	14,342,854.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	40,538	742.500	30,099,465.000	
GEA GROUP AG	24,987	36.030	900,281.610	
BOLLORE	114,808	5.265	604,464.120	
MEDIOBANCA SPA	86,792	12.135	1,053,220.920	
MICHELIN(CGDE)-B	98,907	30.110	2,978,089.770	
CONTINENTAL AG	17,450	66.100	1,153,445.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	144,198	41.740	6,018,824.520	
OMV AG	23,354	45.420	1,060,738.680	
VERBUND AG	10,663	80.250	855,705.750	
PERNOD-RICARD	29,707	169.250	5,027,909.750	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	47.740	1,112,867.140	
RENAULT SA	27,902	37.760	1,053,579.520	
REPSOL SA	199,548	15.385	3,070,045.980	
REMY COINTREAU	2,866	129.000	369,714.000	
MERCK KGAA	18,389	160.800	2,956,951.200	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	69,513	56.950	3,958,765.350	
RWE AG	92,342	36.150	3,338,163.300	
SEB SA	2,596	90.600	235,197.600	
SOCIETE GENERALE-A	104,069	23.280	2,422,726.320	
VINCI S.A.	78,098	106.240	8,297,131.520	
SODEXO	12,910	101.450	1,309,719.500	
SOFINA	2,281	197.300	450,041.300	
SOLVAY SA	11,217	109.150	1,224,335.550	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	79,715	156.920	12,508,877.800	
VIVENDI SE	98,944	8.110	802,435.840	
SAP SE	153,459	126.680	19,440,186.120	
TELEFONICA S.A	750,387	3.987	2,991,792.960	
TOTALENERGIES SE	327,198	61.990	20,283,004.020	
VALEO	26,570	17.030	452,487.100	
E.ON SE	341,735	11.585	3,958,999.970	
VOEST-ALPINE AG	18,032	26.500	477,848.000	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	60.940	815,133.440	
SIEMENS AG-REG	111,980	137.180	15,361,416.400	
UPM-KYMMENE OYJ	77,752	32.110	2,496,616.720	
ING GROEP NV-CVA	540,974	12.798	6,923,385.250	
PUMA AG	17,998	60.360	1,086,359.280	



BAYER AG	139,086	48.645	6,765,838.470	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	12.175	912,638.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	68.060	1,646,439.460	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	117,632	66.440	7,815,470.080	
BASF SE	135,756	45.310	6,151,104.360	
BEIERSDORF AG	15,332	122.100	1,872,037.200	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	71.300	1,539,081.800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	32,346	42.140	1,363,060.440	
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	386.350	2,569,613.850	
ORANGE	280,606	11.100	3,114,726.600	
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	41.640	2,668,291.200	
RANDSTAD NV	15,584	50.860	792,602.240	
ALLIANZ SE	59,323	231.500	13,733,274.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	433,193	4.161	1,802,516.070	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	135,085	29.200	3,944,482.000	
HERMES INTL	4,525	1,874.400	8,481,660.000	
ENDESA S.A.	50,946	19.920	1,014,844.320	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.992	578,157.260	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	32.600	1,489,363.600	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	20,074	375.900	7,545,816.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	80,218	23.760	1,905,979.680	
DASSAULT SYSTEMES SA	101,062	35.265	3,563,951.430	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	36,953	33.620	1,242,359.860	
RHEINMETALL STAMM	5,596	265.000	1,482,940.000	
HEINEKEN NV	43,766	85.620	3,747,244.920	
AKZO NOBEL	23,353	69.280	1,617,895.840	
ASML HOLDING NV	59,236	557.500	33,024,070.000	
AEGON NV	232,433	4.717	1,096,386.460	
VOLKSWAGEN AG	3,315	122.800	407,082.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	31,519	107.440	3,386,401.360	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	887,594	7.156	6,351,622.660	
KERING	10,730	459.450	4,929,898.500	
ACCIONA S.A.	4,432	126.600	561,091.200	
FORTUM OYJ	54,194	12.410	672,547.540	
AGEAS	24,086	39.960	962,476.560	
UCB SA	16,732	82.900	1,387,082.800	
NEMETSCHEK SE	9,878	58.260	575,492.280	
CARREFOUR SA	90,116	16.825	1,516,201.700	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	27.320	482,935.640	
NOKIA OYJ	745,504	3.679	2,742,709.210	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	135,770	19.980	2,712,684.600	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,583	117.350	4,527,715.050	
SANOFI	166,671	101.680	16,947,107.280	

STMICROELECTRONICS NV	99,472	40.650	4,043,536.800	
ELISA OYJ	20,242	44.920	909,270.640	
BANCO SANTANDER SA	2,306,214	3.445	7,944,907.230	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	67,925	15.345	1,042,309.120	
QIAGEN N.V.	34,306	38.060	1,305,686.360	
DEUTSCHE BANK AG-REG	276,499	10.054	2,779,920.940	
BMW VORZUG	7,821	89.150	697,242.150	
ENEL SPA	1,199,910	6.236	7,482,638.760	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	477,387	20.625	9,846,106.870	
SARTORIUS AG	3,651	337.400	1,231,847.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	186,083	31.400	5,843,006.200	
RATIONAL AG	976	612.000	597,312.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	81.780	397,941.480	
BECHTLE AG	14,521	44.560	647,055.760	
KONINKLIJKE KPN NV	504,342	3.227	1,627,511.630	
EUROFINS SCIENTIFIC	17,824	55.020	980,676.480	
TELEPERFORMANCE	7,845	120.800	947,676.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	27,549	164.150	4,522,168.350	
EURAZEO	5,673	55.150	312,865.950	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	73.360	947,664.480	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	72.250	1,278,102.500	
INDITEX	158,488	35.590	5,640,587.920	
ESSILORLUXOTTICA	43,675	173.420	7,574,118.500	
SNAM SPA	344,795	4.760	1,641,224.200	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	11.554	1,928,605.230	
ENAGAS	38,270	16.355	625,905.850	
WENDEL	5,449	78.550	428,018.950	
TENARIS SA	73,186	15.380	1,125,600.680	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.310	281,568.660	
TERNA SPA	207,655	7.726	1,604,342.530	
BIOMERIEUX	4,870	91.400	445,118.000	
GRIFOLS SA	31,982	13.040	417,045.280	
NESTE OYJ	68,725	35.980	2,472,725.500	
RECORDATI SPA	17,680	46.930	829,722.400	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	87,314	11.480	1,002,364.720	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	167.850	1,224,297.900	
KONE OYJ	49,300	40.860	2,014,398.000	
ELIA GROUP	4,078	104.800	427,374.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	246.200	949,101.000	
ENGIE	257,314	15.096	3,884,412.140	
ALSTOM	47,494	23.760	1,128,457.440	
IPSEN SA	5,964	125.800	750,271.200	
ARKEMA SA	10,961	91.400	1,001,835.400	
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	136.700	408,869.700	
LEGRAND SA	38,836	88.240	3,426,888.640	
AMPLIFON SPA	20,249	28.590	578,918.910	

ADP	3,975	112.600	447,585.000	
ORION OYJ	13,559	36.480	494,632.320	
METSO CORPORATION	106,064	10.490	1,112,611.360	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	14.035	833,763.210	
SYMRISE AG	19,815	90.300	1,789,294.500	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	40,316	33.180	1,337,684.880	
PRYSMIAN SPA	38,343	38.760	1,486,174.680	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	90.960	220,941.840	
CAIXABANK	565,553	3.554	2,009,975.360	
BUREAU VERITAS SA	39,729	23.870	948,331.230	
GETLINK	63,509	15.370	976,133.330	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	16.290	646,517.520	
AMADEUS IT GROUP SA	68,598	61.880	4,244,844.240	
BRENTAG SE	21,559	76.540	1,650,125.860	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	17.875	441,280.120	
EDENRED	35,618	58.220	2,073,679.960	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	1.759	241,749.920	
TALANX AG	11,451	64.050	733,436.550	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	68.500	816,177.500	
VONOVIA SE	107,034	23.000	2,461,782.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	160,579	8.444	1,355,929.070	
KNORR-BREMSE AG	10,342	58.580	605,834.360	
OCI NV	12,329	25.630	315,992.270	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	45.270	1,798,893.990	
FERRARI NV	17,998	279.800	5,035,840.400	
ASR NEDERLAND NV	27,948	40.930	1,143,911.640	
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	12.560	1,806,655.520	
AIB GROUP PLC	226,914	3.954	897,217.950	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	32.180	556,488.740	
MONCLER SPA	29,763	57.900	1,723,277.700	
NEXI SPA	83,576	6.034	504,297.580	
PROSUS NV	227,473	28.965	6,588,755.440	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	96.240	1,460,345.760	
JDE PEET'S BV	14,385	25.260	363,365.100	
EXOR NV	14,142	85.200	1,204,898.400	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	12.585	942,515.820	
EURONEXT NV	14,089	64.650	910,853.850	
IMCD NV	8,848	119.800	1,059,990.400	
WORLDLINE SA	36,232	27.380	992,032.160	
NN GROUP NV	36,289	36.280	1,316,564.920	
FINECOBANK SPA	93,118	11.670	1,086,687.060	
ARGENX SE	8,116	488.200	3,962,231.200	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	114,291	24.010	2,744,126.910	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	71,674	33.670	2,413,263.580	

	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	25.920	254,586.240	
	DSM-FIRMENICH AG	29,346	77.890	2,285,759.940	
	ZALANDO SE	31,321	24.500	767,364.500	
	STELLANTIS NV	323,866	17.786	5,760,280.670	
	FERROVIAL SE	75,279	30.300	2,280,953.700	
	AENA SME SA	9,989	140.800	1,406,451.200	
	CELLNEX TELECOM SAU	83,586	35.900	3,000,737.400	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	13.630	720,141.050	
	SCOUT24 SE	10,048	64.860	651,713.280	
	COVESTRO AG	27,558	52.040	1,434,118.320	
	HELLOFRESH SE	17,856	32.540	581,034.240	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	123,927	53.630	6,646,205.010	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	10.120	595,956.680	
	AMUNDI SA	12,553	53.550	672,213.150	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	11.660	488,309.140	
	ADYEN NV	3,145	674.100	2,120,044.500	
	DELIVERY HERO SE	22,564	30.445	686,960.980	
ユーロ 小計		25,776,065		678,470,740.800 (107,137,314,680)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	10.360	2,662,520.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	58.650	14,181,335.400	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	38.550	3,597,254.700	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	177,391	292.200	51,833,650.200	
	MTR CORP	287,941	30.700	8,839,788.700	
	HANG SENG BANK LTD	120,396	96.250	11,588,115.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	20.050	3,427,988.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	38.400	8,172,288.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.520	8,480,961.120	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	322,904	51.400	16,597,265.600	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	21.800	10,878,091.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	15.520	2,685,984.320	
	SINO LAND CO	659,200	8.770	5,781,184.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	80.700	16,508,395.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	55.200	2,926,704.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	204,656	75.900	15,533,390.400	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	11.080	1,972,240.000	
	AIA GROUP LTD	1,688,116	65.400	110,402,786.400	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	8.330	3,857,922.880	
	SANDS CHINA LTD	335,800	25.600	8,596,480.000	

SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	13.360	1,870,400.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	15.780	3,181,248.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	31.050	7,952,991.750	
ESR GROUP LTD	476,800	10.460	4,987,328.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	16.820	4,457,300.000	
WH GROUP LTD	1,665,500	4.070	6,778,585.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	41.350	15,276,550.750	
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	40.800	10,860,756.000	
香港・ドル 小計	11,520,169		363,889,505.320 (6,877,511,651)	
合計	165,988,426		1,119,487,791.696 (1,119,487,791,696)	

## (2) 株式以外の有価証券

2023年9月19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	1,223,357.940	
		GOODMAN GROUP	254,170.000	5,746,783.700	
		GPT GROUP	219,223.000	914,159.910	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	1,068,482.250	
		SCENTRE GROUP	852,352.000	2,224,638.720	
		STOCKLAND	369,843.000	1,483,070.430	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	976,704.550	
	オーストラリア・ドル 小計		2,880,103.000	13,637,197.500 (1,296,351,994)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,527,228.140	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	675,078.000	1,896,969.180	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	810,711.000	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		405,500.000	616,360.000		
シンガポール・ドル 小計		2,341,909.000	4,851,268.320 (525,440,872)		
投資信託受益証券 合計			5,222,012	1,821,792,866 (1,821,792,866)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,059.000	2,702,306.880	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,520,480.850	

	AMERICAN TOWER CORP	68,911.000	12,371,591.830	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	76,762.000	1,585,902.920	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,798.000	3,966,800.040	
	BOSTON PROPERTIES INC	24,257.000	1,584,952.380	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	17,235.000	1,757,108.250	
	CROWN CASTLE INC	65,601.000	6,398,065.530	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	42,218.000	5,406,014.900	
	EQUINIX INC	13,394.000	10,306,281.180	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,598.000	1,769,830.920	
	EQUITY RESIDENTIAL	52,518.000	3,268,195.140	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,774.000	2,187,909.900	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	30,987.000	3,922,954.200	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,660,860.810	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,831.000	1,058,690.230	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	86,248.000	1,714,610.240	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,506,978.340	
	INVITATION HOMES INC	86,531.000	3,000,895.080	
	IRON MOUNTAIN INC	39,185.000	2,471,397.950	
	KIMCO REALTY	94,921.000	1,766,479.810	
	MID AMERICA	17,377.000	2,357,363.820	
	PROLOGIS INC	135,374.000	16,614,451.020	
	PUBLIC STORAGE	23,614.000	6,372,946.320	
	REALTY INCOME CORP	93,882.000	5,044,279.860	
	REGENCY CENTERS CORP	26,932.000	1,681,903.400	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,847.000	3,623,789.700	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	46,844.000	5,351,927.000	
	SUN COMMUNITIES INC	18,505.000	2,298,135.950	
	UDR INC	41,516.000	1,575,117.040	
	VENTAS INC	62,365.000	2,724,726.850	
	VICI PROPERTIES INC	140,502.000	4,334,486.700	
	WELLTOWER INC	70,141.000	5,947,255.390	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,298,635.600	
	WP CAREY INC	34,653.000	2,186,950.830	
アメリカ・ドル	小計	1,845,446.000	135,340,276.860 (19,993,819,101)	
イギリス・ポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,945.000	735,171.970	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,187,592.710	
イギリス・ポ ンド	小計	293,026.000	1,922,764.680 (351,731,343)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	431,215.680	

		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	284,008.560	
	カナダ・ドル 小計		23,146.000	715,224.240 (78,374,272)	
	ユーロ	COVIVIO	5,066.000	215,406.320	
		GECINA SA	9,166.000	892,310.100	
		KLEPIERRE	25,279.000	622,621.770	
		UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	18,477.000	870,081.930	
		WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	488,741.960	
	ユーロ 小計		78,134.000	3,089,162.080 (487,809,584)	
	香港・ドル	LINK REIT	349,516.000	13,089,374.200	
	香港・ドル 小計		349,516.000	13,089,374.200 (247,389,172)	
投資証券 合計			2,589,268	21,159,123,472 (21,159,123,472)	
合計				22,980,916,338 (22,980,916,338)	

(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	71.57	-	-	-	74.72
	投資証券 35銘柄	-	-	-	1.72	
イギリス・ポンド	株式 80銘柄	4.17	-	-	-	4.28
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	1.95	-	-	-	2.10
	投資信託受益証券 7銘柄	-	-	0.11	-	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.38	-	-	-	3.45
	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	-	-	-	0.38
	投資信託受益証券 4銘柄	-	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式 44銘柄	2.82	-	-	-	2.88
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	0.85	-	-	-	0.86
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.91	-	-	-	0.93

ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.19	-	-	-	0.20
ユーロ	株式	223銘柄	9.20	-	-	-	9.42
	投資証券	5銘柄	-	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.59	-	-	-	0.62
	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。



## 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9月19日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,859,524,638
国債証券	475,970,099,200
地方債証券	30,582,695,843
特殊債証券	28,952,408,097
社債証券	24,921,994,010
未収利息	1,136,835,351
前払費用	203,724,399
流動資産合計	564,627,281,538
資産合計	564,627,281,538
負債の部	
流動負債	
未払解約金	89,924,000
流動負債合計	89,924,000
負債合計	89,924,000
純資産の部	
元本等	
元本	456,657,713,948
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	107,879,643,590
元本等合計	564,537,357,538
純資産合計	564,537,357,538
負債純資産合計	564,627,281,538

## 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9月17日 至 2023年9月19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9月19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	591,725,550,821円
同期中追加設定元本額	813,146,348,821円
同期中一部解約元本額	948,214,185,694円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	25,788,587,864円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	55,667,126円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	89,757,098円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	47,808,948円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	790,407,950円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	270,136,769円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	39,243,717円
たわらノーロード 国内債券	19,145,492,646円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,991,347,916円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,452,106,015円
たわらノーロード バランス(標準型)	2,732,405,177円
たわらノーロード バランス(積極型)	368,156,872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)	173,646,089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)	2,200,630,921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)	2,334,242,456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)	655,400,136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)	29,704,320円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	21,903,061円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	184,896,583円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,358,452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>	13,866,749,458円
Oneグローバルバランス	64,140,293円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	10,473,653,217円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	15,139,639,227円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	6,733,908,834円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,560,651,193円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,596,762,947円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	491,089,430円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	74,223,820円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,843,395,929円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,036,864円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	5,033,335,469円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,236,124,153円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	453,119,243円
投資のソムリエ	107,355,802,737円
クルーズコントロール	1,320,115,521円
投資のソムリエ<DC年金>	9,234,951,874円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,070,906,904円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,830,835,825円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,762,517,237円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	35,961,729,892円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	383,141,619円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	198,176,873円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	75,908,795円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,892,876,065円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,235,543,447円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	13,594,435,488円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,905,942,039円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	438,770,255円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	208,241,352円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	128,388,536円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,877,540,311円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	30,095,313円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	141,514,536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 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)	10,285,469,925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)	3,041,952,201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)	591,974,983円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	266,857,109円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(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(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(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)	40,641,303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)	152,012,421円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	102,826,269円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	20,937,674円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	60,112,639円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	29,534,869円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	361,856円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	7,915,295円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	94,405,151円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,846,963,127円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,160,112,347円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,323,452,371円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	56,021,212円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	140,121,301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)	1,683,114,125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)	95,391,779円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	562,815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)	1,721,605,496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)	37,433,405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)	280,407,078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)	426,883,959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)	792,810,719円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	204,203,407円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	97,464,580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>	242,276,909円
コア資産形成ファンド	147,269,745円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	20,421,025,131円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	29,133,886,356円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	18,501,576,706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]	415,368,791円
計	456,657,713,948円
2. 受益権の総数	456,657,713,948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9月17日 至 2023年9月19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9月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年9月19日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	7,781,501,300
地方債証券	61,332,321
特殊債券	135,457,820
社債券	23,628,730
合計	7,954,662,711

（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9月19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9月19日現在
1口当たり純資産額	1.2362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9月19日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 4 2 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,001,320,000	
	4 4 3 回 利付国庫債券(2年)	2,200,000,000	2,201,298,000	
	4 4 4 回 利付国庫債券(2年)	2,700,000,000	2,701,377,000	
	4 4 5 回 利付国庫債券(2年)	2,400,000,000	2,400,984,000	
	4 4 6 回 利付国庫債券(2年)	1,900,000,000	1,900,532,000	
	4 4 7 回 利付国庫債券(2年)	2,600,000,000	2,600,390,000	
	4 4 8 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,000,000	
	4 4 9 回 利付国庫債券(2年)	3,900,000,000	3,899,649,000	
	4 5 0 回 利付国庫債券(2年)	2,200,000,000	2,199,406,000	
	1 4 2 回 利付国庫債券(5年)	2,930,000,000	2,934,922,400	
	1 4 3 回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,706,068,000	
	1 4 4 回 利付国庫債券(5年)	4,530,000,000	4,537,112,100	
	1 4 5 回 利付国庫債券(5年)	7,250,000,000	7,261,527,500	
	1 4 6 回 利付国庫債券(5年)	6,000,000,000	6,008,040,000	
	1 4 7 回 利付国庫債券(5年)	3,250,000,000	3,245,937,500	
	1 4 8 回 利付国庫債券(5年)	4,210,000,000	4,201,916,800	
	1 4 9 回 利付国庫債券(5年)	3,380,000,000	3,371,381,000	
	1 5 0 回 利付国庫債券(5年)	4,670,000,000	4,654,122,000	
	1 5 1 回 利付国庫債券(5年)	3,800,000,000	3,782,786,000	
	1 5 2 回 利付国庫債券(5年)	2,990,000,000	2,986,352,200	

153回 利付国庫債券(5年)	4,110,000,000	4,086,244,200	
154回 利付国庫債券(5年)	5,800,000,000	5,780,396,000	
155回 利付国庫債券(5年)	1,800,000,000	1,806,426,000	
156回 利付国庫債券(5年)	3,600,000,000	3,597,696,000	
157回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,896,181,000	
158回 利付国庫債券(5年)	3,600,000,000	3,576,780,000	
159回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,082,759,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	129,355,600	
2回 利付国庫債券(40年)	330,000,000	373,635,900	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	610,507,800	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	814,147,200	
5回 利付国庫債券(40年)	710,000,000	771,620,900	
6回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	1,001,523,000	
7回 利付国庫債券(40年)	1,280,000,000	1,302,220,800	
8回 利付国庫債券(40年)	1,390,000,000	1,311,173,100	
9回 利付国庫債券(40年)	2,090,000,000	1,439,884,600	
10回 利付国庫債券(40年)	1,830,000,000	1,479,646,500	
11回 利付国庫債券(40年)	1,640,000,000	1,273,361,600	
12回 利付国庫債券(40年)	1,520,000,000	1,047,781,600	
13回 利付国庫債券(40年)	1,990,000,000	1,355,966,100	
14回 利付国庫債券(40年)	2,000,000,000	1,456,940,000	
15回 利付国庫債券(40年)	2,540,000,000	2,033,981,200	
16回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	699,584,000	
336回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,006,680,000	
337回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,309,614,000	
338回 利付国庫債券(10年)	3,230,000,000	3,249,799,900	
339回 利付国庫債券(10年)	3,980,000,000	4,007,103,800	
340回 利付国庫債券(10年)	6,540,000,000	6,589,638,600	
341回 利付国庫債券(10年)	3,620,000,000	3,641,140,800	
342回 利付国庫債券(10年)	3,520,000,000	3,523,942,400	

343回 利付国庫債券(10年)	4,090,000,000	4,092,781,200	
344回 利付国庫債券(10年)	3,570,000,000	3,571,035,300	
345回 利付国庫債券(10年)	5,690,000,000	5,688,122,300	
346回 利付国庫債券(10年)	4,840,000,000	4,834,095,200	
347回 利付国庫債券(10年)	5,390,000,000	5,377,926,400	
348回 利付国庫債券(10年)	4,070,000,000	4,056,243,400	
349回 利付国庫債券(10年)	5,050,000,000	5,025,507,500	
350回 利付国庫債券(10年)	6,060,000,000	6,020,913,000	
351回 利付国庫債券(10年)	4,990,000,000	4,949,032,100	
352回 利付国庫債券(10年)	5,150,000,000	5,102,980,500	
353回 利付国庫債券(10年)	5,190,000,000	5,136,335,400	
354回 利付国庫債券(10年)	4,260,000,000	4,209,348,600	
355回 利付国庫債券(10年)	5,430,000,000	5,356,477,800	
356回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,726,656,000	
357回 利付国庫債券(10年)	4,620,000,000	4,539,612,000	
358回 利付国庫債券(10年)	4,650,000,000	4,558,767,000	
359回 利付国庫債券(10年)	4,550,000,000	4,448,580,500	
360回 利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,484,632,000	
361回 利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,346,055,000	
362回 利付国庫債券(10年)	5,410,000,000	5,242,235,900	
363回 利付国庫債券(10年)	5,770,000,000	5,574,974,000	
364回 利付国庫債券(10年)	5,850,000,000	5,635,305,000	
365回 利付国庫債券(10年)	5,630,000,000	5,406,601,600	
366回 利付国庫債券(10年)	6,280,000,000	6,067,108,000	
367回 利付国庫債券(10年)	5,700,000,000	5,492,178,000	



368回 利付国庫債券(10年)	5,450,000,000	5,237,014,000	
369回 利付国庫債券(10年)	5,620,000,000	5,536,767,800	
370回 利付国庫債券(10年)	5,300,000,000	5,210,218,000	
371回 利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,010,999,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	125,947,800	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	112,657,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	234,184,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	228,828,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	273,435,000	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	260,456,600	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	168,486,000	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	395,739,600	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	305,710,600	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	282,535,200	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	315,233,100	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	463,164,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	324,405,200	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	390,139,200	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	359,668,200	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	343,275,900	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	414,750,000	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	383,328,000	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	727,973,000	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	736,919,600	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	915,645,500	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,011,102,000	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,021,829,600	

31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	824,947,200	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,124,666,500	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,312,360,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,369,548,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,175,084,200	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,516,384,500	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,479,816,000	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	908,327,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,311,712,600	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,097,804,900	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,110,169,800	
42回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,361,022,000	
43回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	1,370,980,500	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,181,177,700	
45回 利付国庫債券(30年)	1,550,000,000	1,562,586,000	
46回 利付国庫債券(30年)	1,970,000,000	1,984,499,200	
47回 利付国庫債券(30年)	1,640,000,000	1,680,672,000	
48回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,697,158,400	
49回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,675,826,000	
50回 利付国庫債券(30年)	1,950,000,000	1,696,149,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,820,000,000	1,404,312,000	
52回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,371,747,000	
53回 利付国庫債券(30年)	1,220,000,000	1,004,743,200	
54回 利付国庫債券(30年)	1,690,000,000	1,454,160,500	
55回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	926,521,200	

56回 利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	975,076,200	
57回 利付国庫債券(30年)	1,530,000,000	1,304,753,400	
58回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,156,312,800	
59回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	926,508,800	
60回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	977,404,800	
61回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,034,661,600	
62回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	869,344,000	
63回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	826,870,000	
64回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,123,080,000	
65回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,045,002,000	
66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	809,695,600	
67回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,306,992,100	
68回 利付国庫債券(30年)	1,640,000,000	1,280,085,600	
69回 利付国庫債券(30年)	1,660,000,000	1,328,581,000	
70回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,229,551,400	
71回 利付国庫債券(30年)	1,480,000,000	1,178,731,200	
72回 利付国庫債券(30年)	1,390,000,000	1,105,341,900	
73回 利付国庫債券(30年)	1,590,000,000	1,262,460,000	
74回 利付国庫債券(30年)	1,590,000,000	1,367,145,600	
75回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,594,835,600	
76回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,539,048,600	
77回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,492,560,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,517,616,000	
79回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	540,726,000	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	389,663,400	

74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,067,200	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	185,680,800	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	71,999,900	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,202,800	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	258,257,500	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,738,500	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	93,286,800	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	415,832,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	145,821,200	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	73,240,300	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	177,486,800	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	620,072,300	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	126,714,000	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	126,415,200	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	625,995,900	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,582,700	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	499,666,400	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	117,273,200	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,234,936,000	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	394,075,900	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	715,928,500	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	593,956,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	128,696,400	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	712,945,200	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	172,200,000	

99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	809,700,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	902,558,600	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	252,151,300	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	550,050,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	175,267,200	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	119,464,400	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	697,606,400	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	547,470,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	656,148,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	747,435,600	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	380,173,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	482,688,800	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	508,663,400	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	814,111,000	
113回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,511,767,600	
114回 利付国庫債券(20年)	410,000,000	453,460,000	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	400,359,600	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	590,775,100	
117回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	520,915,100	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	612,742,200	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	512,558,500	
121回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	703,212,800	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	622,428,600	
123回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	390,131,000	
125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	673,938,000	

126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	565,268,700	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	594,621,000	
128回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	407,876,900	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	997,542,000	
132回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,670,900	
133回 利付国庫債券(20年)	630,000,000	691,047,000	
134回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	219,666,000	
135回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	141,731,200	
136回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	389,415,600	
137回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	523,665,600	
138回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,138,344,600	
139回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,061,006,800	
140回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,456,077,500	
141回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,158,113,600	
142回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	473,761,100	
143回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,333,307,700	
144回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	805,935,000	
145回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,460,915,000	
146回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	2,450,470,400	
147回 利付国庫債券(20年)	2,490,000,000	2,699,135,100	
148回 利付国庫債券(20年)	2,530,000,000	2,715,929,700	
149回 利付国庫債券(20年)	2,990,000,000	3,208,240,100	
150回 利付国庫債券(20年)	3,130,000,000	3,323,214,900	
151回 利付国庫債券(20年)	3,160,000,000	3,283,650,800	
152回 利付国庫債券(20年)	2,640,000,000	2,739,633,600	

153回 利付国庫債券(20年)	2,940,000,000	3,079,650,000	
154回 利付国庫債券(20年)	2,720,000,000	2,814,465,600	
155回 利付国庫債券(20年)	2,480,000,000	2,504,576,800	
156回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,136,337,200	
157回 利付国庫債券(20年)	2,680,000,000	2,437,567,200	
158回 利付国庫債券(20年)	3,040,000,000	2,863,467,200	
159回 利付国庫債券(20年)	2,340,000,000	2,225,269,800	
160回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	2,131,910,400	
161回 利付国庫債券(20年)	2,260,000,000	2,135,248,000	
162回 利付国庫債券(20年)	2,230,000,000	2,099,812,600	
163回 利付国庫債券(20年)	2,430,000,000	2,280,312,000	
164回 利付国庫債券(20年)	2,450,000,000	2,257,724,000	
165回 利付国庫債券(20年)	2,050,000,000	1,881,961,500	
166回 利付国庫債券(20年)	2,140,000,000	2,015,494,800	
167回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,320,007,500	
168回 利付国庫債券(20年)	1,790,000,000	1,597,664,500	
169回 利付国庫債券(20年)	1,920,000,000	1,677,792,000	
170回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,826,685,000	
171回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	1,939,481,600	
172回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,384,964,800	
173回 利付国庫債券(20年)	2,560,000,000	2,232,371,200	
174回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,170,100,000	
175回 利付国庫債券(20年)	2,420,000,000	2,129,212,800	
176回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,102,328,000	
177回 利付国庫債券(20年)	2,750,000,000	2,355,705,000	

	178回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,258,698,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,250,040,000	
	180回 利付国庫債券(20年)	2,620,000,000	2,387,291,600	
	181回 利付国庫債券(20年)	2,210,000,000	2,044,382,600	
	182回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	2,120,033,400	
	183回 利付国庫債券(20年)	2,060,000,000	2,066,262,400	
	184回 利付国庫債券(20年)	1,980,000,000	1,880,366,400	
	185回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	851,634,000	
国債証券 合計		487,695,000,000	475,970,099,200	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,493,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	109,101,300	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	194,690,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	389,700,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	290,604,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	225,408,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	108,734,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	103,017,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	104,049,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	212,272,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	318,942,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,524,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	110,247,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	205,932,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,560,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	396,680,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	394,840,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	96,310,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	241,820,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,663,000	
	237回 神奈川県公募公債	200,000,000	196,916,000	
	251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	193,404,000	
	258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	288,063,000	



3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	118,088,000	
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	109,142,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	331,116,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	108,711,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,355,000	
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	191,804,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	192,458,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	191,490,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	190,448,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	285,504,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	215,942,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	101,734,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	92,984,000	
190回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	297,624,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	351,750,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	108,555,943	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	389,568,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	193,704,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	201,048,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	194,502,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	96,312,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	114,360,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	208,206,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	312,618,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	102,995,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	101,475,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	194,808,000	

令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	96,871,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	192,560,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	104,178,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	104,405,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	203,410,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	104,079,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	328,188,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	330,816,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	110,338,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	212,476,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	149,586,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,689,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	196,334,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	216,990,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	99,208,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	193,620,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	83,153,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	86,300,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	195,192,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	174,262,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	221,928,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	110,388,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	107,011,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	318,801,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	101,913,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,972,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	197,582,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	195,000,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	96,766,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	104,116,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	147,314,000	

20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	108,349,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	110,671,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	321,915,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	201,756,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,787,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	190,682,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	102,784,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	101,487,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	91,645,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	193,072,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	106,105,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,780,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,264,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	604,386,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,940,000	
150回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,262,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,686,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,673,600	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,284,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,805,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,975,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,945,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,680,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,344,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,485,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,485,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,840,000	

194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	294,021,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	487,910,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,260,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	479,910,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	477,540,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,716,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	100,513,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	193,250,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	100,527,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,342,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	198,732,000	
令和2年 2回 大阪市公募公債	300,000,000	291,651,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	218,342,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	194,074,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	106,007,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	102,128,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	106,834,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	221,352,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	216,056,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	297,630,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	155,170,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	389,380,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	116,160,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	108,452,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	106,118,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	110,307,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	277,485,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	197,744,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	219,436,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	110,207,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	108,191,000	

11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	329,991,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	105,955,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	113,447,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	184,652,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	85,365,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,493,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	185,630,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	298,359,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	92,739,000	
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	297,591,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	195,080,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	193,250,000	
26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	100,481,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	196,710,000	
地方債証券 合計	30,689,330,000	30,582,695,843	
特殊債券			
9回 新関西国際空港社債	200,000,000	207,004,000	
12回 新関西国際空港社債	200,000,000	205,232,000	
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	427,440,000	
127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,730,000	
131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	78,027,000	
156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	382,524,000	
33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,067,000	
1回 高速道路機構債	300,000,000	371,031,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	179,430,000	
26回 高速道路機構債	200,000,000	236,002,000	
36回 高速道路機構債	300,000,000	364,449,000	
50回 高速道路機構債	300,000,000	263,946,000	
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,141,000	
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,670,000	
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,351,000	
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,532,000	
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,259,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	91,983,000	

172回 高速道路機構債	200,000,000	179,714,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	92,005,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,768,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,377,000	
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	541,135,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,522,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,188,000	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	305,727,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	502,860,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,987,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,639,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	193,602,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	503,690,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	94,656,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,016,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	181,092,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,660,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	797,016,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	186,896,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	92,248,000	
398回 政保道路債	300,000,000	220,713,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	141,216,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	152,788,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	154,858,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	590,325,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	216,458,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	329,730,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	330,279,000	

13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	110,217,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,619,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	216,906,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	107,236,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	214,928,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,972,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	325,866,000	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	105,881,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,340,000	
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	298,605,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,488,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	204,880,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,003,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	398,752,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,614,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	93,673,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,100,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,605,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,330,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,099,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	251,847,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	223,296,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,080,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	216,994,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,680,700	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	104,244,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	103,278,000	

109回 都市再生機構債券	200,000,000	203,858,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	156,372,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	105,826,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	100,565,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	218,852,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,661,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	384,366,500	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,998,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,212,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,385,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	265,755,000	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,520,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,671,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,665,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	297,927,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,110,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,093,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	496,425,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	496,425,000	
40回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,348,000	41,650,253	
27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,060,000	15,648,243	
29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,635,000	100,209,222	
36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,016,000	149,884,652	
38回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,244,000	20,990,801	
49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,328,000	17,958,046	
52回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,358,000	21,007,623	
53回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,345,000	22,017,367	
60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,164,000	26,890,835	
64回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,326,000	65,550,123	



7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,102,000	29,755,630	
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,308,000	35,681,205	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,053,000	36,430,114	
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,706,000	40,031,192	
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,096,000	41,144,082	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,481,000	45,682,921	
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,432,000	51,902,436	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,352,000	54,119,916	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	205,248,000	197,263,852	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,579,000	67,230,012	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,283,000	67,032,688	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,488,000	67,162,236	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	217,245,000	208,720,306	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	217,062,000	208,420,761	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,212,000	142,160,504	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	222,030,000	212,584,843	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	220,311,000	210,998,454	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	382,620,000	367,533,293	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,394,000	73,303,862	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,932,000	74,863,844	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	254,328,000	239,518,480	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	338,248,000	319,488,765	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,637,000	246,317,603	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	266,529,000	251,944,533	
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	814,527,000	767,944,200	

	6回 沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	413,128,000	
	21回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,804,000	
	い第843号 利付商工債	100,000,000	99,749,000	
	い第851号 利付商工債	300,000,000	298,179,000	
	い第854号 利付商工債	300,000,000	297,753,000	
	い第855号 利付商工債	200,000,000	198,430,000	
	369回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	398,916,000	
	377回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	298,407,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	107,446,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,268,000	
	77回 東日本高速道路社債	300,000,000	296,235,000	
	85回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,064,000	
	87回 中日本高速道路債券	400,000,000	398,112,000	
	71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	100,494,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,201,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	191,918,000	
特殊債券 合計		29,064,027,000	28,952,408,097	
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	293,571,000	
	6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,400,000	
	11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	98,611,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	398,432,000	
	16回 成田国際空港社債	100,000,000	100,483,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	85,069,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,563,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	195,096,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	298,197,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,798,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,726,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	496,360,000	
	25回 西日本高速道路社債	200,000,000	200,972,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	100,722,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	299,709,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	200,116,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,860,000	
	62回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,355,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,480,000	
	10回 キリンホールディングス社債	100,000,000	100,589,000	
	3回 ダイドーグループHD社債	300,000,000	291,075,000	

9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	93,486,000	
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	100,907,000	
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,338,000	
30回 東レ社債	300,000,000	298,041,000	
42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	198,614,000	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	182,450,000	
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,054,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	289,392,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	473,880,000	
4回 住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,853,000	
4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	289,707,000	
14回 プリヂストーン社債	300,000,000	294,618,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	297,477,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	99,927,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	95,800,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	189,426,000	
58回 川崎重工業社債	300,000,000	283,737,000	
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	98,847,000	
26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	198,762,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	91,379,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	390,076,000	
12回 新生銀行社債	400,000,000	398,528,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	106,575,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,751,000	
20回 三井住友信託銀行社債	300,000,000	297,261,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	200,668,000	
11回 セブン銀行社債	200,000,000	200,758,000	
28回 芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,822,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	296,973,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	387,956,000	
69回 ホンダファイナンス社債	300,000,000	297,561,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,130,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,324,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	194,084,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	289,098,000	

23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	97,873,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,726,000	
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,620,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	192,820,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	298,446,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	296,310,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	99,976,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	199,312,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	102,900,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	88,461,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,492,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	207,382,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	108,847,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,633,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	218,096,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	93,540,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,415,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	90,509,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,971,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	71,297,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,047,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	169,082,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	151,412,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,714,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	193,664,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	76,979,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	71,639,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,438,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	168,564,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,278,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	126,733,200	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	69,866,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	289,563,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	192,996,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	388,652,000	
30回 光通信社債	200,000,000	185,758,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	90,753,000	
532回 中部電力社債	200,000,000	193,778,000	
497回 関西電力社債	100,000,000	101,134,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	299,163,000	
530回 関西電力社債	400,000,000	391,304,000	
531回 関西電力社債	200,000,000	171,650,000	

541回	関西電力社債	300,000,000	283,896,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	191,648,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	96,554,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	101,776,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	101,224,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	99,481,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	388,440,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	197,180,000	
536回	東北電力社債	300,000,000	282,201,000	
320回	四国電力社債	300,000,000	286,872,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	89,427,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	88,269,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	285,093,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	82,845,000	
493回	九州電力社債	200,000,000	198,172,000	
507回	九州電力社債	200,000,000	191,998,000	
321回	北海道電力社債	261,000,000	263,142,810	
340回	北海道電力社債	300,000,000	299,532,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	177,954,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	206,094,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	99,176,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	188,930,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	181,810,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	85,776,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	82,338,000	
57回	東京瓦斯社債	300,000,000	200,964,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	198,094,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	182,870,000	
社債券 合計		25,781,000,000	24,921,994,010	
合計			560,427,197,150	

## 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9月19日現在

資産の部	
流動資産	
預金	603,734,325
コール・ローン	1,014,887,977
国債証券	234,744,788,165
派生商品評価勘定	1,410,800
未収利息	1,485,917,688
前払費用	192,040,516
流動資産合計	238,042,779,471
資産合計	238,042,779,471
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,472
未払金	3,086,580,793
未払解約金	62,285,000
流動負債合計	3,148,907,265
負債合計	3,148,907,265
純資産の部	
元本等	
元本	106,913,732,007
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	127,980,140,199
元本等合計	234,893,872,206
純資産合計	234,893,872,206
負債純資産合計	238,042,779,471

## 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9月17日 至 2023年9月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年9月19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	87,114,523,685円
同期中追加設定元本額	56,525,247,823円
同期中一部解約元本額	36,726,039,501円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,577,425,553円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,204,974円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	14,819,705円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	35,243,813円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	31,576,035円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	44,620,416円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,924,026円
たわらノーロード 先進国債券	18,990,749,233円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	350,441,402円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,922,251,460円
たわらノーロード バランス（堅実型）	69,192,222円
たわらノーロード バランス（標準型）	371,769,674円
たわらノーロード バランス（積極型）	83,033,915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）	16,747,849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）	1,022,568,276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）	1,808,017,973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）	887,605,466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）	555,582,556円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,809,901円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,471,309円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	193,505,794円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	15,817,752円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	24,221,491円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,700,164,803円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	1,185,043,595円

Oneグローバルバランス	38,816,645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	2,729,058,633円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	421,484,916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	798,793,509円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,420,160円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	895,628,565円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	35,241,998円
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)	156,090,953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	1,167,476,909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>	746,684,006円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	681,710,496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>	427,219,267円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	8,859,011円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	78,152,059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)	279,330,569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)	285,766,619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)	107,758,536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)	174,657,062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)	275,944,598円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	696,762,966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)	384,313,550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)	249,057,989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)	506,030,195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)	4,897,354,442円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,383,989,296円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,513,856,843円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,276,420,144円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	103,934,930円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	45,504,625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)	466,973,071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)	341,312,577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)	230,792,241円



DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	11,739,546円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	22,465,793円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	6,620,637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）	4,438,393円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	35,281,910円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	1,396,720,298円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	1,312,138,323円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,424,154,337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）	52,279,920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）	109,978,292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）	1,266,546,736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）	197,159,284円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	157,851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）	241,232,557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）	239,339,240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）	355,582,618円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	34,824,471円
動的パッケージファンド<DC年金>	49,141,669円
コア資産形成ファンド	29,642,690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>	2,320,012,843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>	11,847,422,408円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5,900,607,089円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	4,905,935,547円
計	106,913,732,007円
2. 受益権の総数	106,913,732,007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9月17日 至 2023年9月19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9月19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)は短時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9月19日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	4,788,143,086	
合計	4,788,143,086	

(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9月19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9月19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	3,320,000,000	-	3,321,369,328	1,369,328
アメリカ・ドル	1,696,438,000	-	1,696,745,328	307,328
イギリス・ポンド	185,948,000	-	185,906,528	41,472
オーストラリア・ドル	49,418,000	-	49,419,196	1,196
オフショア・人民元	127,374,000	-	127,380,922	6,922
カナダ・ドル	67,075,000	-	67,079,469	4,469
メキシコ・ペソ	33,266,000	-	33,267,158	1,158

ユーロ	1,160,481,000	-	1,161,570,727	1,089,727
合計	3,320,000,000	-	3,321,369,328	1,369,328

## (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。

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。

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9月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1970円 (21,970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9月19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	1,556,252.350	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,212,890.620	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,476,257.820	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,272,649.600	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,382,293.750	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,624,062.480	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,129,777.350	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,370,300.000	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,220,235.140	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,225,403.120	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,699,382.810	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,614,218.760	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,653,403.860	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,662,704.660	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,047,365.240	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,566,175.760	
US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,387,487.880			

US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,611,757.790	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,105,853.120	
US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,785,875.000	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,427,966.800	
US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,539,796.860	
US T N/B 0.625 08/15/30	8,240,000.000	6,407,565.610	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,318,351.570	
US T N/B 0.625 12/31/27	5,320,000.000	4,514,934.390	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,728,132.830	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,172,578.150	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,405,156.260	
US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,056,883.550	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,410,527.310	
US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,475,014.060	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,810,000.000	4,329,000.000	
US T N/B 0.875 09/30/26	4,010,000.000	3,580,961.310	
US T N/B 0.875 11/15/30	9,480,000.000	7,484,385.930	
US T N/B 1.0 07/31/28	4,770,000.000	4,045,742.560	
US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,371,036.310	
US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,620,750.000	
US T N/B 1.125 02/15/31	9,690,000.000	7,759,570.300	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,809,232.020	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	978,097.650	
US T N/B 1.125 02/29/28	6,390,000.000	5,520,111.330	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	1,990,699.210	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,460,000.000	2,664,850.000	
US T N/B 1.125 08/31/28	5,230,000.000	4,454,284.770	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,026,968.750	
US T N/B 1.25 03/31/28	5,010,000.000	4,343,239.430	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,411,500.000	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,880,000.000	2,456,298.410	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,573,337.500	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,194,657.810	
US T N/B 1.25 08/15/31	10,160,000.000	8,083,946.840	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,258,678.110	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,222,472.660	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,490,363.250	
US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	711,474.600	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,533,921.870	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,100,000.000	1,906,652.340	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,044,344.550	
US T N/B 1.375 11/15/31	9,190,000.000	7,337,640.620	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,685,487.460	
US T N/B 1.375 12/31/28	5,900,000.000	5,048,878.910	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,740,000.000	5,177,659.360	
US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,317,167.940	
US T N/B 1.5 02/15/30	5,130,000.000	4,301,785.540	
US T N/B 1.5 08/15/26	7,030,000.000	6,411,030.420	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,644,425.000	

US T N/B 1.5 11/30/24	9,000,000.000	8,597,812.500	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,313,476.550	
US T N/B 1.625 02/15/26	6,090,000.000	5,642,408.800	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,762,458.610	
US T N/B 1.625 05/15/31	8,540,000.000	7,049,503.110	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,392,915.640	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,416,433.580	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,195,735.930	
US T N/B 1.625 11/15/50	6,280,000.000	3,501,590.570	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,645,756.630	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	3,918,867.210	
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,800,625.000	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,610,000.000	3,669,948.040	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,850,000.000	2,449,552.730	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,901,460.530	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,923,396.870	
US T N/B 1.875 02/15/32	8,280,000.000	6,854,287.490	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,200,000.000	3,515,687.480	
US T N/B 1.875 02/15/51	6,280,000.000	3,737,213.300	
US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,292,432.800	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,501,718.750	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,665,968.730	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,846,210.940	
US T N/B 1.875 11/15/51	4,670,000.000	2,765,698.020	
US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,949,395.310	
US T N/B 2.0 02/15/50	4,420,000.000	2,735,047.610	
US T N/B 2.0 08/15/25	4,050,000.000	3,825,193.360	
US T N/B 2.0 08/15/51	6,110,000.000	3,742,136.300	
US T N/B 2.0 11/15/26	3,830,000.000	3,528,237.890	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	2,895,312.500	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,759,597.670	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,250,000.000	2,098,872.050	
US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,712,902.340	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,494,728.120	
US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	2,799,283.180	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,098,583.970	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,174,112.500	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,887,384.380	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,570,000.000	1,720,293.750	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,840,000.000	2,528,549.970	
US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,270,412.100	
US T N/B 2.25 11/15/24	3,080,000.000	2,971,839.040	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,836,199.960	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	2,985,791.020	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,885,273.430	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,615,275.760	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,590,937.520	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,937,244.910	
US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,096,019.540	

US T N/B 2.375 05/15/29	4,470,000.000	4,007,721.650	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	3,733,235.890	
US T N/B 2.375 11/15/49	3,790,000.000	2,565,356.250	
US T N/B 2.5 01/31/25	500,000.000	481,582.030	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,650,883.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,251,963.860	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,156,826.540	
US T N/B 2.5 03/31/27	4,000,000.000	3,725,000.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,230,000.000	1,574,501.950	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,335,414.450	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,403,790.210	
US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,721,476.560	
US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,883,632.820	
US T N/B 2.625 05/31/27	5,910,000.000	5,509,920.700	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,780,748.430	
US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,851,640.640	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,217,589.080	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,891,400.000	
US T N/B 2.75 04/30/27	3,500,000.000	3,281,796.870	
US T N/B 2.75 05/15/25	2,200,000.000	2,115,523.430	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,015,890.620	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	998,237.490	
US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,570,506.250	
US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	6,924,618.750	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	950,925.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,641,968.140	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,752,225.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,189,792.970	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,654,541.000	
US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,927,890.620	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,800,000.000	3,500,156.240	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,860,000.000	4,528,342.940	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,202,234.370	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,777,612.500	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,600,000.000	2,708,156.230	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,382,500.000	
US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,511,799.610	
US T N/B 2.875 06/15/25	2,420,000.000	2,329,155.470	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,113,804.670	
US T N/B 2.875 08/15/28	6,030,000.000	5,601,304.680	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,348,345.890	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	817,003.120	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,215,165.620	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,660,000.000	2,056,460.540	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,043,398.420	
US T N/B 3.0 02/15/49	4,610,000.000	3,551,500.740	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	864,822.650	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	1,006,653.510	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,251,639.840	

US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,083,499.990	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	2,935,485.920	
US T N/B 3.0 08/15/52	3,740,000.000	2,880,822.650	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,681,845.690	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,179,643.340	
US T N/B 3.0 11/15/44	2,260,000.000	1,770,921.860	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	669,305.070	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,115,146.860	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,740,000.000	1,409,535.920	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,232,825.780	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,923,239.820	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,676,204.490	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,940,000.000	3,732,072.630	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,893,818.550	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,880,000.000	4,575,000.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	839,985.930	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,130,053.120	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,500,000.000	3,336,347.660	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,300,000.000	3,095,425.770	
US T N/B 3.375 05/15/33	2,500,000.000	2,315,234.370	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,930,000.000	1,614,037.880	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,471,620.300	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,950,000.000	3,261,218.750	
US T N/B 3.5 01/31/28	3,380,000.000	3,241,763.270	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,500,000.000	2,369,531.250	
US T N/B 3.5 02/15/33	8,800,000.000	8,241,750.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,000,000.000	900,585.930	
US T N/B 3.5 04/30/30	2,000,000.000	1,894,218.760	
US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,912,929.680	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,418,354.680	
US T N/B 3.625 02/15/53	3,700,000.000	3,227,382.790	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,800,000.000	3,661,953.140	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,000,000.000	1,908,593.760	
US T N/B 3.625 05/15/26	3,500,000.000	3,395,410.160	
US T N/B 3.625 05/15/53	2,010,000.000	1,754,824.220	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,282,374.010	
US T N/B 3.75 04/15/26	6,000,000.000	5,841,093.720	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,220,000.000	1,104,147.640	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,295,807.020	
US T N/B 3.875 01/15/26	5,800,000.000	5,667,007.790	
US T N/B 3.875 02/15/43	2,500,000.000	2,270,507.790	
US T N/B 3.875 03/31/25	1,050,000.000	1,028,815.430	
US T N/B 3.875 05/15/43	800,000.000	725,875.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,197,331.620	
US T N/B 3.875 09/30/29	2,950,000.000	2,857,582.030	
US T N/B 3.875 11/30/27	3,000,000.000	2,921,015.640	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,300,000.000	2,227,675.780	
US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,479,789.070	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,711,734.360	

US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,918,593.760	
US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,926,054.680	
US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,132,750.010	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,500,000.000	2,438,085.950	
US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	2,889,290.620	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,860,000.000	4,542,011.680	
US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,056,876.580	
US T N/B 4.125 01/31/25	1,800,000.000	1,771,804.690	
US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,618,851.580	
US T N/B 4.125 09/30/27	3,920,000.000	3,854,309.380	
US T N/B 4.125 10/31/27	2,340,000.000	2,300,055.470	
US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,475,906.280	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	933,263.660	
US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,939,687.510	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	973,183.580	
US T N/B 4.25 12/31/24	5,500,000.000	5,424,267.580	
US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	603,093.740	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,198,089.050	
US T N/B 4.375 05/15/41	930,000.000	915,505.070	
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	2,046,833.780	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	992,656.250	
US T N/B 4.5 02/15/36	500,000.000	514,375.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	609,468.740	
US T N/B 4.5 07/15/26	6,600,000.000	6,548,437.500	
US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	988,498.430	
US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,534,300.000	
US T N/B 4.5 11/30/24	4,200,000.000	4,155,621.070	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,890,000.000	1,931,528.320	
US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,608,872.270	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,270,647.660	
US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	596,017.960	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,395,720.700	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,160,000.000	1,234,040.610	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,457,750.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,200,000.000	1,270,031.250	
US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	837,894.490	
アメリカ・ドル 小計	885,680,000.000 (130,841,506,400)	772,150,320.280 (114,069,766,819)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,579,242.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,115,855.950
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,200,000.000	2,067,071.600
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,636,808.320
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,130,000.000	1,876,346.820



UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	929,782.240	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	2,180,000.000	1,776,983.400	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	533,002.560	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	988,545.400	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,650,000.000	1,068,342.000	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,190,000.000	453,397.610	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,670,000.000	787,418.360	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,800,000.000	1,295,915.760	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,330,000.000	1,088,997.610	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,670,000.000	2,047,546.100	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,610,000.000	990,646.840	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	258,578.940	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	978,302.600	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,930,000.000	902,854.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,800,000.000	1,051,920.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,800,000.000	1,657,260.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	540,402.390	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,110,000.000	544,585.420	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	904,861.180	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,470,000.000	740,292.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	371,674.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	830,000.000	467,713.300	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	580,029.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,338,110.550	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,051,631.760	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	773,425.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,840,000.000	1,481,759.720	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	1,800,000.000	1,642,770.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,550,000.000	1,289,158.250	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	743,747.760	

	UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,455,075.000	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	700,000.000	634,410.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	821,709.100	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,400,000.000	1,179,640.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	800,550.000	
	UK TREASURY 4.0 10/22/63	520,000.000	461,164.910	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,390,000.000	2,347,649.200	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,500,000.000	1,462,875.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,820,000.000	1,811,846.400	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,010,411.490	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,010,000.000	1,002,289.660	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,013,641.590	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,186,249.600	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	940,026.710	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,512,000.000	1,402,471.300	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	550,000.000	548,234.350	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,203,498.720	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,265,000.000	1,229,327.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,495,000.000	1,536,726.640	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,380,000.000	1,398,629.440	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,785,000.000	1,787,069.870	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	731,110.160	
	イギリス・ポンド 小計	80,064,000.000 (14,646,107,520)	63,519,584.580 (11,619,637,607)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	320,000.000	305,938.880	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,330,000.000	1,212,515.780	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,773,691.290	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,374,457.800	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	700,000.000	564,596.900	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,720,000.000	1,245,894.040	

	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,900,322.000	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	660,000.000	486,358.620	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,560,000.000	1,453,905.960	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,172,889.760	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,910,000.000	1,740,976.460	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,110,000.000	1,282,728.210	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,292,188.620	
イスラエル・シケル 小計		19,640,000.000 (759,773,400)	17,806,464.320 (688,843,072)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,690,000.000	1,616,676.990	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,349,231.010	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,815,000.000	1,641,268.100	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,670,000.000	2,091,938.150	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,348,575.470	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,680,715.950	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,810,000.000	1,497,460.080	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,420,000.000	788,573.820	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,250,000.000	1,834,700.830	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,230,000.000	1,142,899.920	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,060,000.000	1,874,997.910	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,020,000.000	802,504.120	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	559,284.780	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,366,574.370	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	900,000.000	850,068.210	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,304,122.370	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,040,000.000	803,683.350	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	2,070,000.000	1,864,070.610	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,700,000.000	1,680,516.790	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,500,000.000	1,445,859.700	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	709,646.690	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	800,000.000	747,059.900	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	778,916.130	
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,800,000.000	1,727,039.700		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,613,420.470		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,699,402.740		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,590,000.000	1,634,400.270		
オーストラリア・ドル 小計		41,015,000.000 (3,898,885,900)	36,453,608.430 (3,465,280,017)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	10,000,000.000	9,977,263.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	10,000,000.000	9,948,077.300	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	19,959,638.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,483,151.110	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	49,500,000.000	49,481,412.250	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,763,473.880	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	39,500,000.000	39,445,206.770	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	25,000,000.000	24,900,753.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	26,000,000.000	25,960,308.920	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	12,300,000.000	12,331,727.850	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,119,618.160	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,438,898.510	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	14,300,000.000	14,201,104.630	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	17,500,000.000	17,510,843.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	16,600,000.000	16,652,809.580	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	28,600,000.000	28,881,395.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	13,000,000.000	13,004,862.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	20,111,026.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,176,926.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,052,416.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	26,000,000.000	26,260,234.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,144,344.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,111,049.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	33,300,000.000	33,629,340.330	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	20,500,000.000	20,810,866.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	12,100,000.000	12,307,397.630	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	22,100,000.000	22,519,955.250	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	15,000,000.000	15,360,289.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	13,000,000.000	13,354,560.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	41,000,000.000	41,794,092.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	7,500,000.000	7,665,972.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,259,763.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,941,439.730	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,208,607.350	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	19,320,000.000	20,601,292.740	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	10,100,000.000	10,742,651.890	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	16,450,000.000	18,000,104.880	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,253,339.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	6,600,000.000	7,499,294.880	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	12,500,000.000	14,394,726.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	5,800,000.000	6,705,833.560	
	オフショア・人民元 小計	751,320,000.000 (15,213,628,944)	763,966,068.300 (15,469,701,710)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,272,415.360	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,129,882.430	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,058,353.440	
	CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	775,512.890	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	491,877.360	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,152,808.550	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	664,696.650	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,210,000.000	1,094,109.730	
	CANADA 1.25 06/01/30	2,350,000.000	1,992,077.680	
	CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,044,600.270	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,575,884.380	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,770,000.000	2,344,439.660	
	CANADA 1.5 09/01/24	240,000.000	232,102.750	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,620,000.000	2,199,004.890	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,452,621.950	
	CANADA 2.0 06/01/28	830,000.000	760,886.200	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,540,000.000	1,337,044.480	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,491,868.150	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,266,238.720	

	CANADA 2.25 06/01/29	530,000.000	487,137.320	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,000,000.000	913,701.250	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,370,719.290	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,180,000.000	1,084,611.200	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,250,000.000	1,185,304.370	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,160,000.000	996,829.420	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	320,793.350	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,400,000.000	1,349,942.520	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,605,369.030	
	CANADA 3.0 11/01/24	860,000.000	840,271.060	
	CANADA 3.25 09/01/28	500,000.000	482,398.870	
	CANADA 3.25 12/01/33	700,000.000	670,641.370	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,130,000.000	1,102,232.450	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	391,025.720	
	CANADA 3.5 12/01/45	680,000.000	664,229.840	
	CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,140,779.800	
	CANADA 4.0 06/01/41	770,000.000	799,185.310	
	CANADA 5.0 06/01/37	230,000.000	260,126.780	
	CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	810,130.680	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	706,910.950	
	カナダ・ドル 小計	48,840,000.000 (5,351,887,200)	43,518,766.120 (4,768,786,391)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	480,000.000	450,208.800	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	477,284.580	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	740,000.000	653,016.580	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	381,870.720	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	393,146.250	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	940,000.000	906,456.140	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	890,000.000	794,445.500	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	763,859.020	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	171,020.900	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	331,194.060	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	360,000.000	339,773.060	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	625,825.200	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	576,313.040	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	197,039.950	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	602,813.920	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	123,654.520	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	370,000.000	367,549.860	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	580,000.000	582,679.600	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	803,674.310		
	シンガポール・ドル 小計	10,175,000.000 (1,102,054,250)	9,541,826.010 (1,033,475,175)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,004,427.360	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,062,335.060	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,910,000.000	3,443,607.250	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	8,210,000.000	7,670,708.470	

	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,500,000.000	2,260,797.340	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	3,857,556.960	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,822,573.590	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,470,000.000	3,704,225.000	
スウェーデン・クローナ 小計		36,370,000.000 (482,266,200)	33,826,231.030 (448,535,823)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,200,000.000	2,114,150.770	
	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,026,237.310	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,260,000.000	2,030,418.240	
	DENMARK 0.5 11/15/27	5,850,000.000	5,300,356.800	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,290,000.000	4,587,415.620	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,540,000.000	5,369,170.760	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,400,000.000	1,311,022.520	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,330,000.000	9,851,049.670	
デンマーク・クローネ 小計		37,950,000.000 (803,781,000)	34,589,821.690 (732,612,423)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	522,400.080	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	512,503.660	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	684,640.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	240,924.990	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	440,000.000	347,761.690	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	720,000.000	690,130.160	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	621,054.700	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	540,000.000	344,999.570	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	550,000.000	496,707.250	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	398,691.180	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	121,434.650	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	783,294.560	
ニュージーランド・ドル 小計		6,950,000.000 (607,499,500)	5,764,542.490 (503,878,659)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,178,602.100	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,510,000.000	3,834,378.540	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,316,861.100	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,600,000.000	3,339,777.600	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,091,071.500	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,590,653.200	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,901,191.500	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,830,000.000	2,473,468.110	
NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,706,339.740		
ノルウェー・クローネ 小計		29,320,000.000 (401,097,600)	26,432,343.390 (361,594,458)	

ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,632,456.640	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,470,000.000	4,197,772.530	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,370,000.000	3,321,632.630	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,920,000.000	2,915,311.840	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	2,092,098.350	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,616,799.590	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,156,202.200	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,133,801.580	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,744,200.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,545,941.100	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,498,933.800	
	POLAND 5.75 04/25/29	2,190,000.000	2,243,624.340	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,100,000.000	2,307,140.850	
ポーランド・ズロチ 小計	36,930,000.000 (1,256,694,663)	33,405,915.450 (1,136,773,237)		
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	1,008,432.830	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	646,084.380	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,364,992.450	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,000,093.200	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,423,662.970	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,791,639.980	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,645,000.860	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	750,000.000	755,799.970	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	703,448.900	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,007,740.600	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,745,392.840	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,675,532.780	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	920,000.000	929,418.680	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,750,000.000	2,774,842.400	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,622,701.080	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	683,365.550	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	600,000.000	609,950.160	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,071,210.210	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,600,000.000	1,637,705.920	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,248,275.640	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,048,553.600	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	1,007,683.330	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,600,000.000	1,702,296.000	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	316,636.830		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,100,000.000	1,174,038.690		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,150,171.310		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,732,922.080		
マレーシア・リングgit 小計	36,950,000.000 (1,163,278,375)	37,477,593.240 (1,179,888,329)		
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,080,000.000	21,872,017.200	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	11,680,000.000	10,830,046.400	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	14,290,000.000	12,403,148.400	



	MEXICAN BONDS 07/31/53	13,290,000.000	11,205,596.400	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,659,477.850	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	18,702,000.000	18,519,243.660	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	40,282,000.000	36,398,761.210	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	28,146,000.000	26,067,699.360	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	31,148,000.000	28,002,986.440	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	21,007,000.000	17,521,518.560	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	9,335,000.000	8,173,539.300	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,408,572.460	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	21,061,000.000	17,905,851.590	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	25,159,000.000	23,935,014.650	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	16,642,000.000	15,116,760.700	
	メキシコ・ペソ 小計	303,377,000.000 (2,616,474,937)	275,020,234.180 (2,371,912,010)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,180,000.000	964,047.020	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,310,000.000	1,034,619.660	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	890,000.000	843,501.950	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	570,000.000	486,168.390	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	250,155.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	680,000.000	453,492.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,420,000.000	1,234,261.160	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,070,000.000	974,947.620	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	160,920.490	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,135,000.000	1,023,009.550	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	311,247.420	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,106,753.550	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	116,730.500	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,100,000.000	911,213.600	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	901,328.400	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	506,518.160	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	100,890.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	200,000.000	195,966.150	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	490,000.000	356,602.400	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	360,000.000	348,366.600	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	256,370.790	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	615,039.230	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	600,000.000	580,514.400	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	640,000.000	609,101.440	

AUSTRIA 3.15 10/20/53	200,000.000	186,926.400	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	329,453.520	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,082,143.290	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,210,000.000	1,254,373.120	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	682,194.900	
BELGIUM 0.0 10/22/27	1,080,000.000	952,055.640	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	803,250.240	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,300,000.000	1,061,840.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,250,000.000	974,375.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	950,000.000	566,392.850	
BELGIUM 0.5 10/22/24	450,000.000	435,519.900	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	314,709.480	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,880,000.000	1,797,338.710	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,260,000.000	1,156,319.640	
BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	844,308.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,700,000.000	1,505,642.400	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,560,000.000	1,469,022.360	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,570,000.000	1,333,601.960	
BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	678,784.860	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,490,000.000	872,018.030	
BELGIUM 1.45 06/22/37	380,000.000	294,187.640	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	616,298.800	
BELGIUM 1.7 06/22/50	880,000.000	580,833.440	
BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	493,272.230	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	305,955.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	282,056.970	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	287,739.180	
BELGIUM 3.0 06/22/33	500,000.000	485,387.450	
BELGIUM 3.0 06/22/34	980,000.000	944,968.920	
BELGIUM 3.3 06/22/54	270,000.000	245,698.380	
BELGIUM 3.45 06/22/43	100,000.000	96,186.400	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	643,648.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	930,000.000	982,359.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,376,117.760	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,100,500.350	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,620,000.000	1,854,362.160	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,570,000.000	1,726,891.670	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,910,000.000	3,622,810.500	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,510,178.820	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,610,000.000	1,455,559.140	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,860,000.000	1,702,141.800	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,650,000.000	2,483,845.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,266,988.500	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,280,000.000	2,150,655.600	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	700,000.000	660,961.000	
BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,531,301.970	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,800,000.000	1,757,484.000	
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	700,000.000	678,706.000	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	1,350,000.000	1,328,778.000	

DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,520,000.000	1,285,372.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,340,000.000	1,929,868.200	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,900,000.000	2,327,221.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,360,000.000	987,183.200	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,880,000.000	1,322,185.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,430,000.000	2,029,195.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	744,093.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,990,000.000	2,434,398.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	651,743.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,497,271.320	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,010,000.000	483,981.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,040,000.000	919,958.400	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,445,801.400	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,560,000.000	2,230,750.720	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,942,301.600	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,930,000.000	2,576,264.030	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,570,000.000	2,284,087.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,825,140.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,860,000.000	3,632,028.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,270,000.000	2,061,636.700	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,310,000.000	2,116,373.490	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,590,000.000	2,379,935.460	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,490,000.000	2,131,940.490	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,660,000.000	1,292,376.400	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,320,876.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,820,000.000	2,035,814.400	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,330,000.000	2,154,108.300	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,350,000.000	1,067,431.500	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,400,000.000	2,320,080.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,850,000.000	1,791,207.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,370,000.000	2,233,440.600	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,170,000.000	2,042,167.470	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,397,377.800	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,330,000.000	2,624,455.590	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	1,991,159.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,286,412.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,020,000.000	2,391,962.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	2,005,399.900	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,820,000.000	3,342,292.200	

DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,458,685.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	939,806.400	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	650,000.000	732,381.000	
FINLAND 0.0 09/15/24	310,000.000	299,322.360	
FINLAND 0.0 09/15/26	430,000.000	390,870.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	168,907.200	
FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	186,632.600	
FINLAND 0.125 04/15/52	660,000.000	276,543.300	
FINLAND 0.125 09/15/31	600,000.000	472,053.000	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	171,332.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	430,039.740	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	221,570.510	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	361,362.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	572,346.450	
FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	257,519.330	
FINLAND 0.75 04/15/31	400,000.000	335,817.600	
FINLAND 0.875 09/15/25	910,000.000	867,648.600	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	387,444.480	
FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	197,415.330	
FINLAND 1.375 04/15/47	380,000.000	257,503.960	
FINLAND 1.5 09/15/32	550,000.000	476,760.900	
FINLAND 2.625 07/04/42	430,000.000	382,222.700	
FINLAND 2.75 04/15/38	270,000.000	247,724.460	
FINLAND 2.75 07/04/28	390,000.000	383,946.810	
FINLAND 4.0 07/04/25	510,000.000	515,179.050	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	2,190,000.000	2,084,551.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,530,000.000	3,264,572.240	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,100,000.000	2,785,613.500	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,990,000.000	3,039,981.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,590,000.000	2,974,369.730	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,780,000.000	3,832,878.850	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	4,770,000.000	3,699,497.520	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,220,000.000	2,937,802.420	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,730,000.000	3,552,815.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,060,000.000	4,708,603.240	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	4,190,000.000	3,633,362.690	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,250,000.000	773,720.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	261,908.700	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,390,000.000	768,325.280	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	4,280,000.000	3,866,528.460	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,110,000.000	4,592,602.280	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,570,000.000	1,756,190.100	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,550,000.000	1,221,916.650	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,500,000.000	4,003,555.500	
FRANCE OAT 03/25/25	3,970,000.000	3,769,455.450	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,760,000.000	3,482,647.360	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,609,019.780	

FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	2,902,304.240	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,780,000.000	2,937,816.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	300,000.000	222,270.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,480,000.000	4,882,948.520	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,470,000.000	2,210,546.150	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	600,992.280	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,570,000.000	2,034,951.700	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	1,180,000.000	1,155,045.360	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,250,000.000	1,650,483.000	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,550,000.000	2,305,594.260	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,750,000.000	4,580,909.390	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,200,000.000	1,010,262.000	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	520,000.000	509,033.200	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	1,500,000.000	1,472,392.500	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,390,000.000	4,327,122.030	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	700,000.000	684,883.500	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,340,000.000	2,205,213.660	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,872,832.020	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,613,172.330	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,544,900.460	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,040,000.000	2,156,734.920	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,940,000.000	3,291,529.920	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,630,844.940	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,800,000.000	3,138,013.200	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,810,000.000	3,364,351.180	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,283,731.870	
IRISH 0.0 10/18/31	870,000.000	680,467.020	
IRISH 0.2 05/15/27	620,000.000	558,416.640	
IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	450,518.200	
IRISH 0.35 10/18/32	600,000.000	470,354.400	
IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	267,943.820	
IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	154,186.880	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	644,647.340	
IRISH 1.0 05/15/26	900,000.000	851,588.100	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	656,880.280	
IRISH 1.3 05/15/33	90,000.000	76,096.010	
IRISH 1.35 03/18/31	460,000.000	408,001.140	
IRISH 1.5 05/15/50	670,000.000	436,846.700	
IRISH 1.7 05/15/37	680,000.000	553,080.040	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	649,341.000	
IRISH 2.4 05/15/30	760,000.000	730,906.050	
IRISH 3.0 10/18/43	310,000.000	289,261.000	
IRISH 5.4 03/13/25	820,000.000	844,488.130	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,835,372.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,450,000.000	1,300,650.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,297,032.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,242,606.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,716,273.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,000,000.000	828,300.000	

ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,489,647.670	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	935,550.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,920,000.000	1,456,848.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,552,851.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,662,627.250	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,980,000.000	1,262,844.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,480,000.000	1,123,320.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,094,040.000	
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	1,313,799.100	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,001,440.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,293,373.600	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,630,000.000	1,504,879.570	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,558,963.550	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	930,600.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,880,000.000	1,808,466.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	480,000.000	466,966.620	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	610,000.000	346,480.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,760,000.000	1,691,738.400	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,850,000.000	2,690,970.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,990,000.000	1,622,878.830	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,140,000.000	1,803,127.620	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,320,000.000	714,551.560	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	751,640.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,197,716.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,440,000.000	2,255,891.300	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,597,004.660	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,900,000.000	1,777,997.200	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	2,490,000.000	2,376,002.820	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	191,196.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	302,124.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,501,755.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,049,104.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,830,000.000	1,542,607.650	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	749,800.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,508,380.950	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,610,881.660	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,154,142.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,820,000.000	1,733,186.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	990,000.000	705,474.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	452,200.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,124,280.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,834,302.980	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,235,000.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,110,000.000	1,996,467.230	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,260,000.000	1,023,035.030	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	508,620.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	929,757.400	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,620,000.000	1,444,139.280	

ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,350,000.000	1,320,030.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	961,337.930	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,710,000.000	1,697,688.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,098,424.720	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	300,000.000	291,900.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,498,486.500	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,430,000.000	1,223,626.820	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,676,370.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,170,000.000	2,036,762.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,100,840.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,100,000.000	1,093,180.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,000,000.000	1,000,300.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,200,000.000	1,138,200.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,143,127.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	370,000.000	345,321.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,680,000.000	2,774,566.480	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,660,000.000	1,642,709.440	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	560,000.000	568,462.720	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,160,000.000	2,245,752.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,790,000.000	1,837,793.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,250,000.000	1,282,750.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,940,000.000	2,070,174.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,460,000.000	1,613,154.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,773,384.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,210,000.000	2,430,558.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	384,720.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	2,460,000.000	2,285,824.620	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,067,787.900	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,310,000.000	1,120,357.850	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	351,804.750	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,400,000.000	604,434.720	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	573,743.800	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,400,000.000	1,114,029.780	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,360,000.000	1,165,243.920	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,210,000.000	806,153.260	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,420,000.000	1,321,026.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,100,000.000	890,005.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,360,000.000	1,250,388.080	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,580,000.000	1,423,628.980	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	519,677.920	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,064,700.900	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	450,000.000	430,986.600	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,510,000.000	1,420,910.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,420,000.000	1,534,239.000	

NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,620,000.000	1,771,308.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	940,000.000	1,033,060.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	2,050,000.000	1,952,748.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,511,448.600	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,610,000.000	1,435,234.500	
SPAIN 0.0 01/31/28	2,180,000.000	1,886,136.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	819,270.950	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,880,000.000	1,450,420.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,486,067.400	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,287,629.600	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,291,951.890	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,454,902.900	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,750,000.000	1,587,425.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,461,830.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	900,000.000	601,920.900	
SPAIN 1.0 07/30/42	840,000.000	497,280.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,390,000.000	676,211.370	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,810,000.000	1,163,790.180	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,150,000.000	1,849,860.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,930,000.000	1,809,394.300	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	1,985,456.920	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,670,000.000	1,522,038.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,900,000.000	1,708,627.830	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,260,000.000	2,090,906.800	
SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	176,829.850	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,910,000.000	1,785,850.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,580,118.740	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,690,000.000	1,369,300.530	
SPAIN 1.9 10/31/52	970,000.000	587,273.110	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,730,000.000	1,664,557.560	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,603,420.100	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,762,130.020	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,302,420.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,571,458.220	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,910,000.000	1,461,037.310	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,290,000.000	1,276,240.860	
SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,766,070.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,430,000.000	1,155,452.870	
SPAIN 3.15 04/30/33	1,870,000.000	1,782,917.840	
SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	662,815.040	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	927,419.360	
SPAIN 3.55 10/31/33	1,520,000.000	1,490,208.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,600,000.000	1,639,577.600	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,931,815.680	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,830,000.000	1,957,370.550	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,710,000.000	1,863,900.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	2,060,000.000	2,225,109.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,369,905.130	
SPAIN 5.75 07/30/32	1,815,000.000	2,102,973.340	



	SPAIN 5.9 07/30/26	2,230,000.000	2,372,686.550	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,660,000.000	1,864,702.900	
	ユーロ 小計	545,417,000.000 (86,126,798,470)	486,948,910.360 (76,894,102,435)	
国債証券 合計		265,271,734,358.500 (265,271,734,359)	234,744,788,165 (234,744,788,165)	
合計			234,744,788,165 (234,744,788,165)	

(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	48.56	48.59
イギリス・ポンド	国債証券 57銘柄	4.95	4.95
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.29	0.29
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.48	1.48
オフショア・人民元	国債証券 41銘柄	6.59	6.59
カナダ・ドル	国債証券 39銘柄	2.03	2.03
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.44	0.44
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.19	0.19
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.31	0.31
ニュージーランド・ドル	国債証券 12銘柄	0.21	0.21
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.15	0.15
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.48	0.48
マレーシア・リングギット	国債証券 27銘柄	0.50	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	1.01	1.01
ユーロ	国債証券 352銘柄	32.74	32.76

(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。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間(2023年9月20日から2024年3月19日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【Oneグローバルバランス】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2023年9月19日現在	第3期中間計算期間末 2024年3月19日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	22,784,731	37,144,874
親投資信託受益証券	409,266,239	785,762,109
流動資産合計	432,050,970	822,906,983
資産合計	432,050,970	822,906,983
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,062,281	9,952,996
未払受託者報酬	52,153	90,844
未払委託者報酬	1,739,667	3,029,417
その他未払費用	6,094	10,699
流動負債合計	5,860,195	13,083,956
負債合計	5,860,195	13,083,956
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	395,993,814	687,423,762
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	30,196,961	122,399,265
(分配準備積立金)	23,716,114	12,721,316
元本等合計	426,190,775	809,823,027
純資産合計	426,190,775	809,823,027
負債純資産合計	432,050,970	822,906,983

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 2022年9月17日 至 2023年3月16日	第3期中間計算期間 自 2023年9月20日 至 2024年3月19日
<b>営業収益</b>		
受取利息	20	38
有価証券売買等損益	1,207,805	60,595,870
<b>営業収益合計</b>	<b>1,207,785</b>	<b>60,595,908</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,301	1,756
受託者報酬	15,836	90,844
委託者報酬	528,933	3,029,417
その他費用	1,794	10,699
<b>営業費用合計</b>	<b>547,864</b>	<b>3,132,716</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>1,755,649</b>	<b>57,463,192</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>1,755,649</b>	<b>57,463,192</b>
<b>中間純利益又は中間純損失( )</b>	<b>1,755,649</b>	<b>57,463,192</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	118,736	8,097,331
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>1,125,359</b>	<b>30,196,961</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>954,134</b>	<b>67,644,027</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	954,134	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	67,644,027
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>5,851,136</b>	<b>24,807,584</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	24,807,584
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,851,136	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>	<b>7,659,274</b>	<b>122,399,265</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自 2023年9月20日	至 2024年3月19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。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年9月16日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2023年9月19日、当中間計算期間末日を2024年3月19日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間末
	2023年9月19日現在	2024年3月19日現在
1. 期首元本額	71,062,409円	395,993,814円
期中追加設定元本額	527,599,029円	603,475,450円
期中一部解約元本額	202,667,624円	312,045,502円
2. 受益権の総数	395,993,814口	687,423,762口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期中間計算期間末
	2023年9月19日現在	2024年3月19日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 2023年9月19日現在	第3期中間計算期間末 2024年3月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0763円 (10,763円)	1.1781円 (11,781円)

（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、「外国株式パッシブ・ファンド・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」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年3月19日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,434,056,682
株式	564,599,728,720
派生商品評価勘定	224,375,500
未収入金	1,297,360
未収配当金	823,495,026
差入委託証拠金	472,069,745
流動資産合計	574,555,023,033
資産合計	574,555,023,033
負債の部	
流動負債	
前受金	177,581,000
未払解約金	163,946,000
流動負債合計	341,527,000
負債合計	341,527,000
純資産の部	
元本等	
元本	119,581,122,919
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	454,632,373,114
元本等合計	574,213,496,033
純資産合計	574,213,496,033
負債純資産合計	574,555,023,033

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年9月20日 至 2024年3月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年3月19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	116,525,629,287円
同期中追加設定元本額	29,392,767,819円
同期中一部解約元本額	26,337,274,187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	2,427,957,436円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,803,476,000円
One DC 国内株式インデックスファンド	31,447,940,239円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,598,103,505円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,952,801円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,229,561円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	17,989,649円
たわらノーロード TOPIX	2,336,851,145円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス(堅実型)	45,869,796円
たわらノーロード バランス(標準型)	348,228,467円
たわらノーロード バランス(積極型)	600,955,337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)	2,173,074円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	137,239,900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)	397,481,491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)	346,930,114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)	484,358,393円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	355,445円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,321,347円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	26,187,688円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,043,900円



たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,427,982円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,369,064,961円
Oneグローバルバランス	49,690,349円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	886,333,060円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,282,275,290円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,837,194,456円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	284,864,677円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	951,693,966円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,082,040,540円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,070,522,519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)	275,712,033円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	328,268,624円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	555,148,066円
投資のソムリエ	7,425,491,210円
クルーズコントロール	376,994,748円
投資のソムリエ<DC年金>	740,007,699円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	373,555,697円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,111,593,157円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	695,786,110円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,245,694,106円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	74,627,658円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	38,110,231円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,144,353円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	129,212,188円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	503,163,784円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	605,706,951円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	218,436,749円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	74,933,981円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	40,857,597円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	24,829,654円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	507,112,390円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,032,184円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,609,480円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	30,082,078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)	348,992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)	282,142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)	1,140,019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)	200,478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)	17,866,508円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	715,577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)	143,247,305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)	173,190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)	75,853,270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)	352,912,231円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	427,966円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	243,760,134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)	11,580,471円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	21,692,711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)	76,736,840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)	361,860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)	2,987,134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)	33,738,800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)	66,106,652円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,503,989円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,989,221円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,983,765円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	78,072円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	527,239円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	14,655,614円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	262,782,719円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	381,518,306円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,177,195,183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)	10,098,008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)	14,307,224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)	138,065,612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)	26,871,729円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	51,649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)	146,879,891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)	7,621,803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)	36,279,078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)	97,254,934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)	125,128,389円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	16,666,139円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	6,265,731円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,746,688円
コア資産形成ファンド	13,022,014円
MHAMトピックスファンド	780,906,922円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	44,598,715円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,030,548,533円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,856,154,779円
計	119,581,122,919円

2. 受益権の総数

119,581,122,919口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年3月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	2024年3月19日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	9,285,009,000	-	-	9,509,500,000	224,491,000
合計	9,285,009,000	-	-	9,509,500,000	224,491,000

## (注)時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2024年3月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.8019円 (48,019円)

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2024年3月19日現在

資産の部	
流動資産	
預金	14,205,286,452
コール・ローン	1,300,304,641
株式	1,350,637,618,225
投資信託受益証券	2,192,723,486
投資証券	24,157,781,119
派生商品評価勘定	129,368,630
未収入金	11,248,152
未収配当金	2,091,015,517
差入委託証拠金	10,820,987,728
流動資産合計	1,405,546,333,950
資産合計	
1,405,546,333,950	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,644,360
未払解約金	1,180,114,000
流動負債合計	1,185,758,360
負債合計	
1,185,758,360	
純資産の部	
元本等	
元本	163,557,022,651
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,240,803,552,939
元本等合計	1,404,360,575,590
純資産合計	1,404,360,575,590
負債純資産合計	1,405,546,333,950

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年9月20日 至 2024年3月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年3月19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	158,050,663,273円
同期中追加設定元本額	41,448,754,269円
同期中一部解約元本額	35,942,394,891円

## 元本の内訳

## ファンド名

DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,532,457,245円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,531,018円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,946,049円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	15,643,534円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,653,628円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	19,283,292円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,461,739円
たわらノーロード 先進国株式	58,962,891,658円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	57,729,353円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,830,495,321円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	916,899,062円
たわらノーロード バランス(堅実型)	80,325,474円
たわらノーロード バランス(標準型)	738,655,825円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,015,134,038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)	32,233,557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)	198,822,048円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	237,912,625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)	419,709,712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)	120,479円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	12,569,975円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,689,467円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,456,033円
たわらノーロード 全世界株式	2,513,082,156円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	57,372,897,840円
One DC 先進国株式インデックスファンド	3,425,468,025円
Oneグローバルバランス	27,062,821円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	133,183,835円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	745,754,687円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,007,188,825円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	80,037,542円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	228,321,872円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	237,223,346円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,324,819円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	656,949,333円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	118,434,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	152,861,972円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	180,864,861円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	304,174,535円
投資のソムリエ	8,619,062,719円
クルーズコントロール	104,334,373円
投資のソムリエ<DC年金>	859,097,185円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	206,309,358円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	287,825,855円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	978,008,883円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,155,003,013円
ワールドアセットバランス(基本コース)	97,564,574円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	257,273,136円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	54,555,588円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	27,859,122円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	8,631,732円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	188,131,366円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	138,504,634円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	892,072,483円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	121,142,743円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	59,901,376円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	29,871,163円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	18,266,077円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	138,047,893円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,411,872円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	25,317,198円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	19,396,857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)	19,533,074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)	10,423,128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)	11,746,414円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	236,047円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04(適格機関投資家限定)	49,519,728円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	17,309,195円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	39,486,425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)	210,437,728円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	34,350,513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)	986,979,993円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	197,573,080円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,138,153,080円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	282,900,395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)	780,957円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	5,095,322円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	32,165,991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)	3,475,958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)	18,507,699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)	36,283,107円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,373,559円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,224,017円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	818,230円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	28,619円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	289,321円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,077,202円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	96,102,279円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	183,173,681円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	645,969,399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)	27,748,003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）	23,590,398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）	150,853,631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）	4,859,990円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	127,981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）	53,127,705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）	4,180,922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）	19,894,103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）	35,528,857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）	68,636,051円
動的パッケージファンド<DC年金>	12,852,907円
コア資産形成ファンド	6,438,543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>	2,059,687,388円
MHAM外国株式インデックスファンド	131,391,213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>	1,005,182,925円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	1,506,926,166円
MHAM外国株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,784,937,491円
計	163,557,022,651円
2. 受益権の総数	163,557,022,651口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年3月19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）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2024年3月19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	67,755,724	-	67,711,420	44,304
イギリス・ポンド	42,189,324	-	42,147,410	41,914
カナダ・ドル	25,566,400	-	25,564,010	2,390
買建	163,649,878	-	163,648,387	1,491
アメリカ・ドル	96,986,500	-	96,986,695	195
ユーロ	66,663,378	-	66,661,692	1,686
合計	231,405,602	-	231,359,807	42,813

## (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。

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。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	2024年3月19日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	27,297,827,202	-	27,421,508,659	123,681,457
合計	27,297,827,202	-	27,421,508,659	123,681,457

## (注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

2024年3月19日現在	
1口当たり純資産額	8.5864円
(1万口当たり純資産額)	(85,864円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年3月19日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,117,200,033
国債証券	362,135,821,100
地方債証券	28,436,005,204
特殊債証券	28,515,503,087
社債証券	23,572,912,800
未収利息	963,228,376
前払費用	194,377,488
流動資産合計	445,935,048,088
資産合計	445,935,048,088
負債の部	
流動負債	
未払解約金	122,879,000
流動負債合計	122,879,000
負債合計	122,879,000
純資産の部	
元本等	
元本	360,600,114,082
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	85,212,055,006
元本等合計	445,812,169,088
純資産合計	445,812,169,088
負債純資産合計	445,935,048,088

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年9月20日 至 2024年3月19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	2024年3月19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	456,657,713,948円
同期中追加設定元本額	262,405,238,732円
同期中一部解約元本額	358,462,838,598円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	26,753,777,173円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	56,606,049円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	83,794,095円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	46,315,205円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	763,575,046円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	271,566,704円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	40,009,486円
たわらノーロード 国内債券	19,323,818,416円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,895,970,816円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,576,204,286円
たわらノーロード バランス（標準型）	3,123,296,903円
たわらノーロード バランス（積極型）	436,325,299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）	191,021,085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）	2,478,668,228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）	2,794,498,364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）	858,752,276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）	37,844,662円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	21,191,977円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	191,376,660円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	7,133,889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>	13,159,408,203円
Oneグローバルバランス	123,114,551円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	11,312,884,569円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	16,593,994,759円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	7,668,726,462円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,707,138,773円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,802,870,079円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	534,043,634円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	74,055,112円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,816,801,094円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,416,875円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	5,336,641,824円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	2,398,362,318円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	490,992,063円
投資のソムリエ	44,221,084,400円
クルーズコントロール	1,306,022,948円
投資のソムリエ<DC年金>	4,422,370,670円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,131,261,436円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,303,027,839円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,045,784,251円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	16,252,676,884円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	545,972,511円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	277,816,010円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	44,644,936円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,046,489,125円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,694,877,435円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,249,169,702円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,222,529,390円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	722,130,645円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	298,203,555円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	182,906,121円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,363,532,228円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	43,989,637円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	167,643,892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)	1,176,465,986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)	1,180,748,851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)	1,063,284,485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)	711,214,929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)	1,102,885,686円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	3,003,361,187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)	2,024,896,587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)	1,047,907,304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)	2,064,669,536円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	1,295,740,647円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,518,995,200円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,179,872,920円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,464,139,434円
A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	600,004,807円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	268,617,735円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,397,299,626円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,408,636,925円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,381,224,582円

インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,952,599,195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)	18,114,968円
AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	465,443,530円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	152,568,268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)	99,670,158円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	22,019,882円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	56,527,921円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	28,145,338円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	392,490円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,979,056円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	82,965,944円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,644,188,899円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,158,861,856円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,440,053,914円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	57,152,082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)	134,993,108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)	1,557,472,447円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	101,283,649円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	585,199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)	1,463,978,318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)	28,673,450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)	273,779,440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)	488,596,499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)	786,087,746円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	206,261,467円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	55,168,465円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	387,569,601円
動的パッケージファンド<DC年金>	237,473,764円
コア資産形成ファンド	116,582,081円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	17,229,123,161円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	27,289,129,190円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	19,520,455,638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]	133,614,350円
計	360,600,114,082円
2. 受益権の総数	360,600,114,082口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年3月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
<p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年3月19日現在	
1口当たり純資産額	1.2363円
(1万口当たり純資産額)	(12,363円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

2024年3月19日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,664,212,916
コール・ローン	993,111,968
国債証券	250,936,468,614
未収利息	1,802,183,116
前払費用	216,648,953
流動資産合計	255,612,625,567
資産合計	255,612,625,567
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	335,760
未払金	883,620,133
未払解約金	25,991,000
流動負債合計	909,946,893
負債合計	909,946,893
純資産の部	
元本等	
元本	109,942,399,226
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	144,760,279,448
元本等合計	254,702,678,674
純資産合計	254,702,678,674
負債純資産合計	255,612,625,567

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年9月20日 至 2024年3月19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	2024年3月19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	106,913,732,007円
同期中追加設定元本額	21,803,449,122円
同期中一部解約元本額	18,774,781,903円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,961,292,644円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,145,444円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	13,270,219円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	33,055,375円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	28,939,320円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	42,934,640円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,209,559円
たわらノーロード 先進国債券	20,692,398,505円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,276,122,119円
たわらノーロード バランス（堅実型）	69,654,836円
たわらノーロード バランス（標準型）	399,627,562円
たわらノーロード バランス（積極型）	92,779,082円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	17,502,872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）	1,061,586,472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）	1,883,362,514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）	956,087,512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）	740,822,112円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,188,463円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	12,364,733円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	190,261,014円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	23,588,598円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	39,031,471円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,898,849,438円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	1,496,713,955円
O n eグローバルバランス	70,175,378円



DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,950,246,653円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	415,782,480円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	845,994,321円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,358,394円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	887,363,869円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,501,610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)	262,055,899円
クルーズコントロール	1,073,014,665円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	227,947,583円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	892,473,101円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	700,592,108円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,389,997円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	511,384,920円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	5,252,936円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	94,525,706円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	977,002,254円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	3,421,962円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	3,493,162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)	162,014,989円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,990,250円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	8,421,563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)	449,691,265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)	3,106,082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)	721,365,220円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	452,867,447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)	4,796,609,055円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,376,075,010円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,511,896,047円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,271,887,210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)	220,797,418円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	43,447,982円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	5,615,404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)	324,864,740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)	212,236,628円

D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,712,376円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	20,041,026円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,986,048円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	52,122円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,586,237円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	29,409,168円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,230,623,518円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,244,027,591円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,361,665,747円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	50,679,091円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	100,536,087円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,111,632,666円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	199,119,944円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	155,470円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	194,234,843円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	259,885,828円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	334,547,889円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	33,343,801円
動的パッケージファンド<DC年金>	50,865,289円
コア資産形成ファンド	25,616,459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>	3,551,937,767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>	12,116,538,595円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5,972,362,832円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	5,034,407,129円
計	109,942,399,226円
2. 受益権の総数	109,942,399,226口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年3月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年3月19日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	395,400,000	-	395,064,240	335,760
アメリカ・ドル	225,555,000	-	225,530,064	24,936
ユーロ	169,845,000	-	169,534,176	310,824
合計	395,400,000	-	395,064,240	335,760

## (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。

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。

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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2024年3月19日現在
1口当たり純資産額	2.3167円
(1万口当たり純資産額)	(23,167円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2024年3月29日現在

資産総額	868,990,313円
負債総額	12,538,569円
純資産総額（ - ）	856,451,744円
発行済数量	714,619,123口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1985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

2024年3月29日現在

資産総額	581,644,072,468円
負債総額	881,105,960円
純資産総額（ - ）	580,762,966,508円
発行済数量	119,065,934,990口
1口当たり純資産額（ / ）	4.8777円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産総額	1,455,362,521,812円
負債総額	2,067,047,897円
純資産総額（ - ）	1,453,295,473,915円
発行済数量	163,850,372,628口
1口当たり純資産額（ / ）	8.8697円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産総額	543,039,099,090円
負債総額	7,317,321,000円
純資産総額（ - ）	535,721,778,090円
発行済数量	433,125,953,938口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2369円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産総額	262,715,000,404円
負債総額	2,508,387,432円
純資産総額（ - ）	260,206,612,972円
発行済数量	110,334,194,806口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3583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。

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

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

### (5)受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6)受益権の再分割

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

### (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額(2024年3月29日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構(2024年3月29日現在)

###### 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。

###### 投資運用の意思決定機構

##### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年3月29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	1,568,631,628,093
追加型株式投資信託	782	16,548,026,663,425
単位型公社債投資信託	21	34,479,319,590
単位型株式投資信託	199	1,065,363,345,162
合計	1,028	19,216,500,956,270



### 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		
建物	1,109	1,001
器具備品	158	118
リース資産	-	7
無形固定資産		
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産		
投資有価証券	241	182
関係会社株式	5,349	5,810
長期差入保証金	1,102	775
繰延税金資産	3,092	2,895
その他	367	104
固定資産計	15,983	15,918
資産合計	103,810	102,265

(単位:百万円)

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

## （ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：百万円 ）

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

（単位：百万円）

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

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

## 重要な会計方針

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



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

## （会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過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あります。

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あります。

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あります。

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

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。

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

## 第37期（2022年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	30,332	30,332	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	30,334	30,334	-

## 第38期（2023年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	29,184	29,184	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,186	29,186	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第37期（2022年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	-	-	-
(2) 金銭の信託	30,332	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	17,567	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,348	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	83,670	1	-	-

## 第38期（2023年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	33,770	-	-	-
(2) 金銭の信託	29,184	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,279	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,307	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	82,540	1	-	-

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第37期（2022年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	6,932	-	6,932
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
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	-	-	-	-
其他有価証券	-	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（其他有価証券）		
非上場株式	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第37期(2022年3月31日現在)

(百万円)

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

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

第38期(2023年3月31日現在)

(百万円)

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

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

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

## 4. 減損処理を行った有価証券

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

(退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(百万円)

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



## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

## (企業結合等関係)

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

MHAM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、TB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、DIAM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」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」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IA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」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」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

## (3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

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

## (2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,429百万円	8,039百万円
経常利益	8,429百万円	8,039百万円
税引前当期純利益	8,429百万円	8,039百万円
当期純利益	7,015百万円	6,744百万円
1株当たり当期純利益	175,380円68銭	168,617円97銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,618百万円	4,228百万円

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

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

（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

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。

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		
建物	1	947
器具備品	1	100
リース資産	1	6
無形固定資産		
ソフトウェア		4,959
ソフトウェア仮勘定		2,954
電話加入権		2,002
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		8,557
関係会社株式		184
長期差入保証金		4,888
繰延税金資産		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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物           ...     8～18年 器具備品     ...     2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
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	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>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。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

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

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



（金融商品関係）

第39期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

### 1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

### 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

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

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

#### 投資有価証券

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

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

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

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)			
1. 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額4,888百万円)については市場価格がない ことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略し ております。			
2. その他有価証券			
区分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額182百万円)については、市場価格がないことから、上 表に含めておりません。			

(持分法損益等)

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

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

MHAM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、TB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、DIAM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」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」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IA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」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」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (収益認識関係)

## 1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第39期中間会計期間  
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

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

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

## (セグメント情報等)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

## 1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2.関連情報

## (1)サービスごとの情報

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

## (2)地域ごとの情報

## 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。

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## (1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
Pay Pay 証券株式会社	( 1 ) 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

( 1 ) 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】

該当事項はありません。

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  
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  
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。  
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  
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」と称して使用することがあります。

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

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 公認会計士 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOneグローバルバランスの2022年9月17日から2023年9月19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、Oneグローバルバランスの2023年9月19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、継続企業的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、継続企業的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。継続企業的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) X B R L 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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR L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

2024年5月24日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOneグローバルバランスの2023年9月20日から2024年3月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、Oneグローバルバランスの2024年3月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月20日から2024年3月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

## 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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。