

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券報告書  
**【提出先】** 関東財務局長殿  
**【提出日】** 2024年9月11日提出  
**【計算期間】** 第15期（自 2023年12月12日 至 2024年6月11日）  
**【ファンド名】** ワールドアセットバランス（基本コース）  
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）  
**【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】** 積木 利浩  
**【連絡場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号  
**【電話番号】** 03-6774-5100  
**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

## 第一部【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】

各ファンドは、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。

各ファンドの信託金限度額は、各々2,000億円とします。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 日本を除く先進国の株式、債券、不動産投資信託証券(リート)および新興国の株式、債券に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

●上記資産に関しては、主としてマザーファンド(\*)を通じて実質的に投資します。また、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等へ直接投資する場合があります。

●DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

(\*)外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド

※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 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

## 3 基本コース、リスク抑制コースの2コースからお選びいただけます。

●各資産への基本投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直します。

※経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

●基本コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行います。

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

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

(\*\*) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本投資比率をもとに運用を行います。

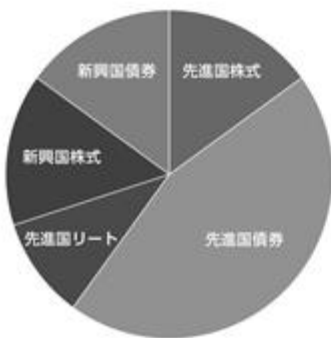
●各コース間でスイッチングが可能です。

※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。

## 基本投資比率のイメージ

基本コース      リスク抑制コース



※基本投資比率は、原則として年1回見直しします。  
 ※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。

## 基本コース

投資対象資産の合計資産比率の変更は行いません。



※この図においては、左記の5つの資産への投資比率の合計を「合計資産比率」として表示しています。以下同じ。  
 ※合計資産比率には、ETFおよび有価証券指数等先物取引等を含みます。

## リスク抑制コース

基本投資比率をもとに投資対象資産の合計資産比率を、現金等\*を用いて機動的に変更し、基準価額の下落の抑制をめざします。



※合計資産比率は、10%～100%程度とします。それにあわせて現金等\*の比率は変動します。

リスク抑制コースでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等は機動的に合計資産比率を減少（現金等\*比率を増加）させることで基準価額の下落を一定水準（下値目安値）までに抑えることをめざします。その後、市場環境回復局面では合計資産比率を増加（現金等\*比率を減少）させます。下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

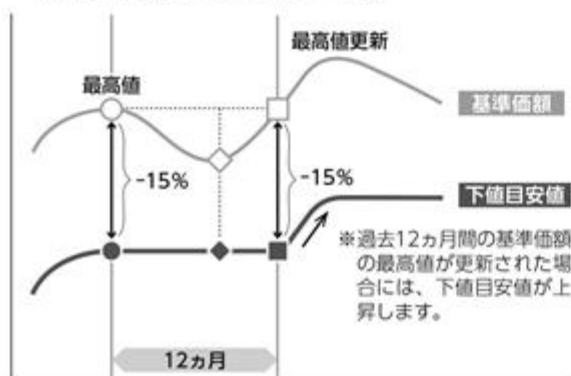
\*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。  
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

## (リスク抑制コース)の下値目安値について

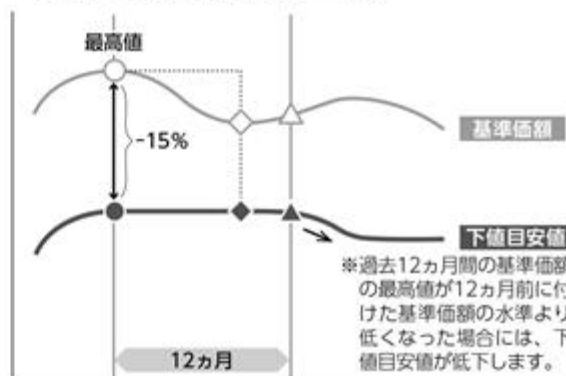
下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。

※（基本コース）は、下値目安値を定めておりません。  
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

## 下値目安値が上昇するケース



## 下値目安値が低下するケース



※下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去12ヵ月間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去12ヵ月間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

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

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

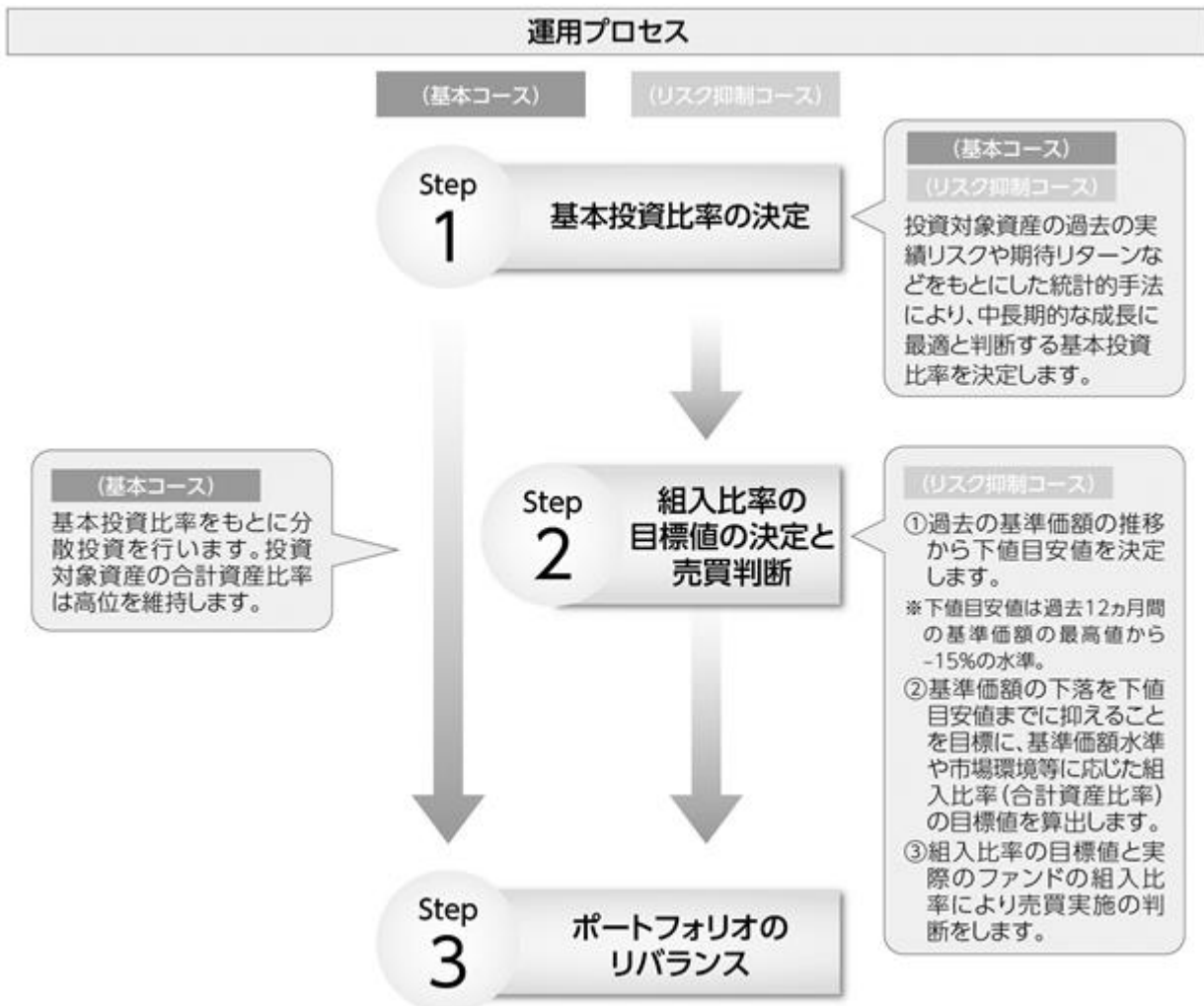
## 4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

## 5 年2回決算を行います。

- 毎年6月、12月の各11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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



## 商品分類表

## 各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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

## 属性区分表

## 各ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル (日本除く)  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 (フルヘッジ)
不動産投信  その他資産 ( )	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
資産複合 (投資信託証 券(債券、株 式、不動産投 信)、先物、 ETF、短期 金融資産) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

資産複合(投資信託証券 (債券、株式、 不動産投信)、先物、E TF、短期金融資産) 資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産(投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産)を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル (日本除く)	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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジあり (フルヘッジ)	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

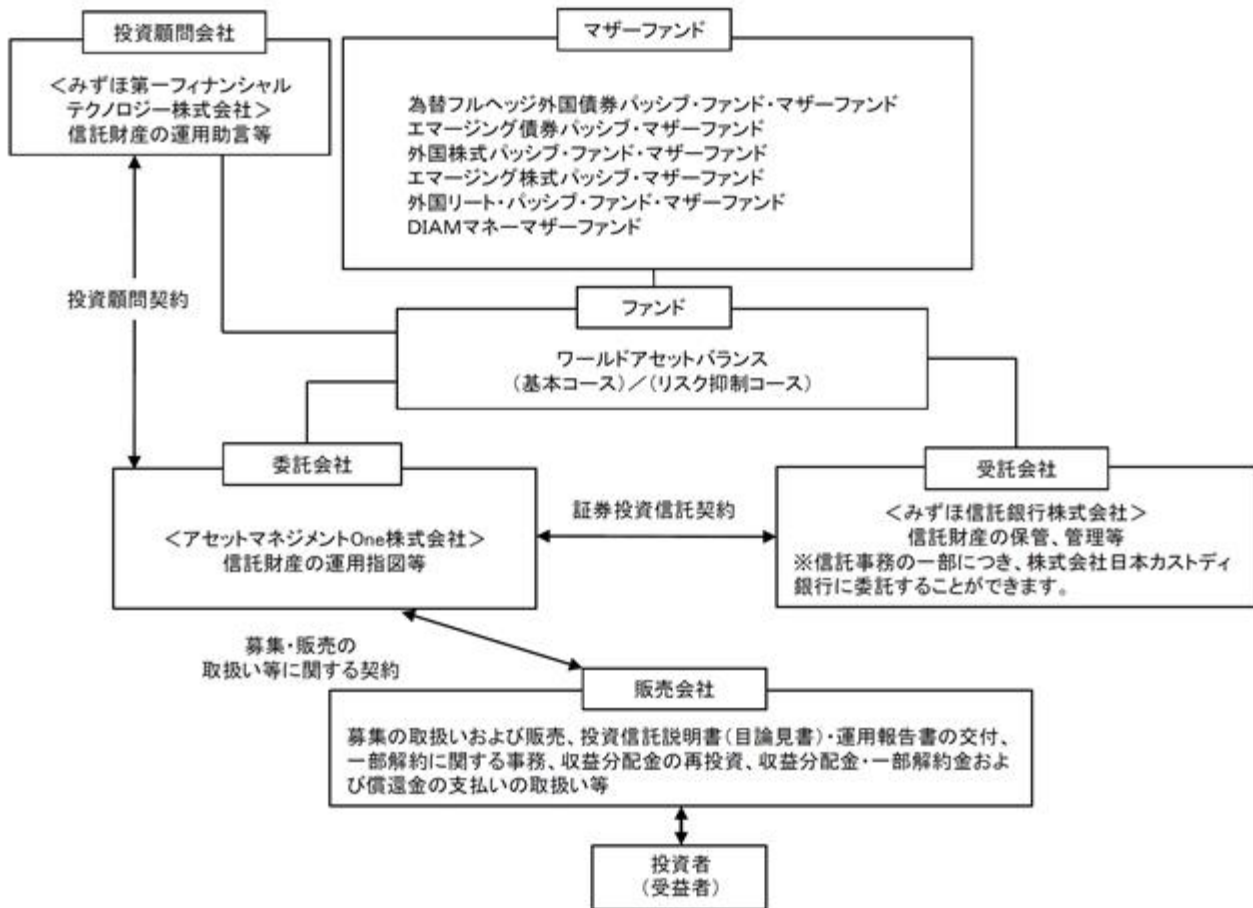
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年1月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、各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、各ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

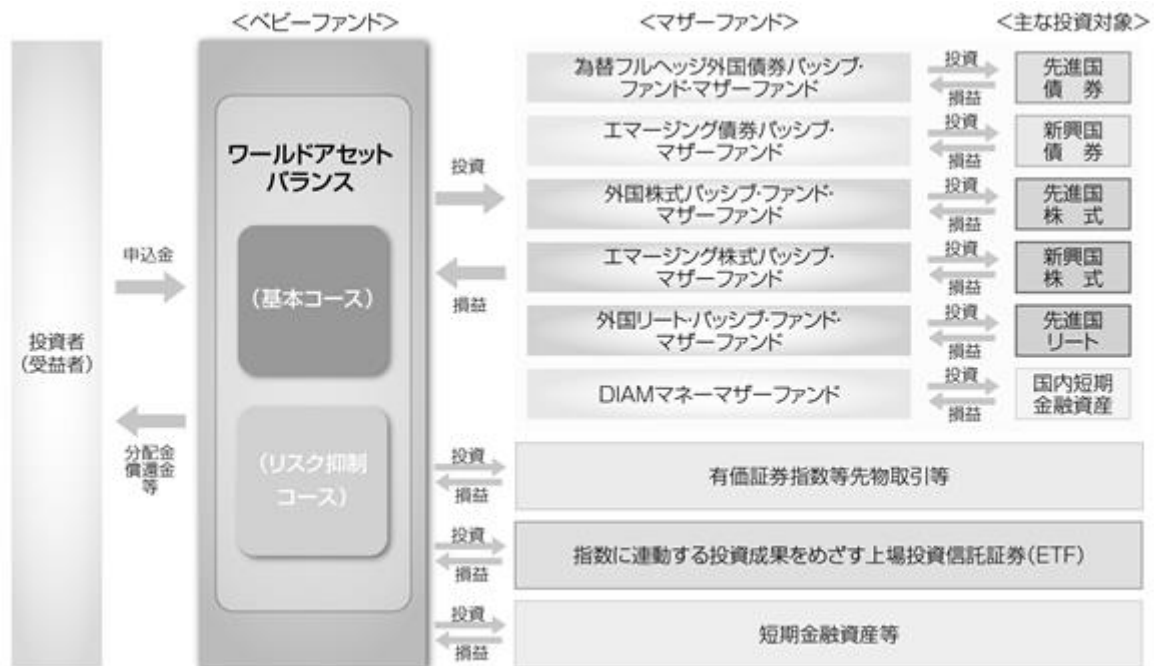
当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。



「ファミリーファンド方式」とは

各ファンドは「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（各ファンド）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。



## 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6月28日現在）

## 委託会社の沿革

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

## 大株主の状況

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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

#### <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>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）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等に投資する場合があります。

#### <投資態度>

以下のマザーファンド受益証券、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

「D I A Mマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとE T Fおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率は、原則として高位を保ちます。

各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

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。

#### ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

##### <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>

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

##### <投資態度>

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

- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・上記のほか、D I A Mマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

基準価額の下落を一定水準(下値目安値<sup>(\*)</sup>)までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率<sup>(\*\*)</sup>を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去12ヵ月間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

(\*\*) 合計資産比率とは、「D I A Mマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。  
各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。  
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。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

b.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証券投資信託である外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、D I A Mマネーマザーファンドの各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

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

9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

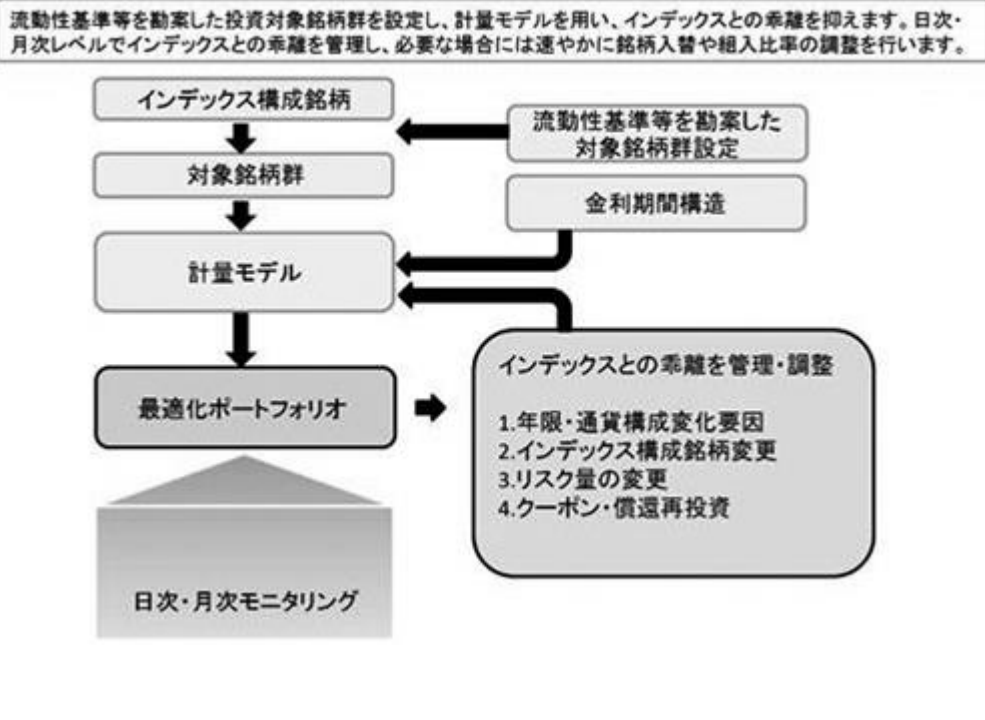
運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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5.の権利の性質を有するもの

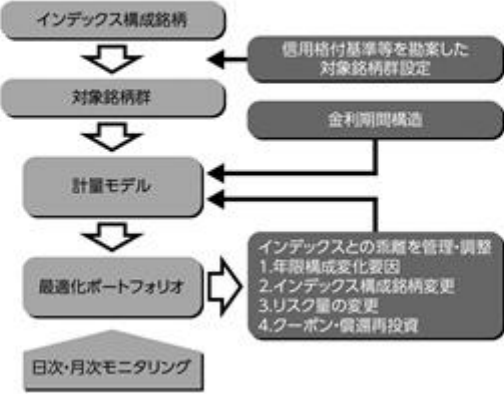
(参考)各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	------------------------------

基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]          F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; C     G[金利期間構造] --&gt; C          D --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整]     subgraph H [ ]         H1[1.年限・通貨構成変化要因]         H2[2.インデックス構成銘柄変更]         H3[3.リスク量の変更]         H4[4.クーポン・償還再投資]     end </pre>

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します。</li> <li>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債等への投資は、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割合には、制限を設けません。</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	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</li> <li>3. 組入債券は、当初組入時において、S &amp; PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</li> <li>4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> 
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

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(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><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>
------	--

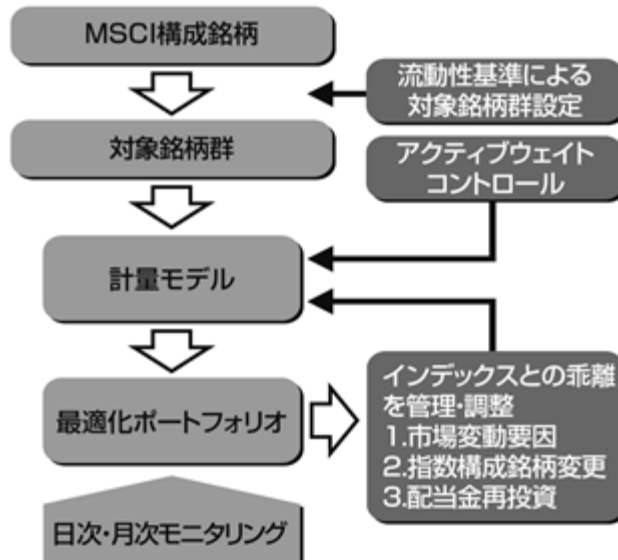
本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関す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、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

運用プロセス

- 1.流動性基準による対象銘柄群設定  
 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。
- 2.最適化法によるポートフォリオの構築  
 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。
- 3.インデックスとの乖離を管理  
 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。  
 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。
  - ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
  - ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
  - ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



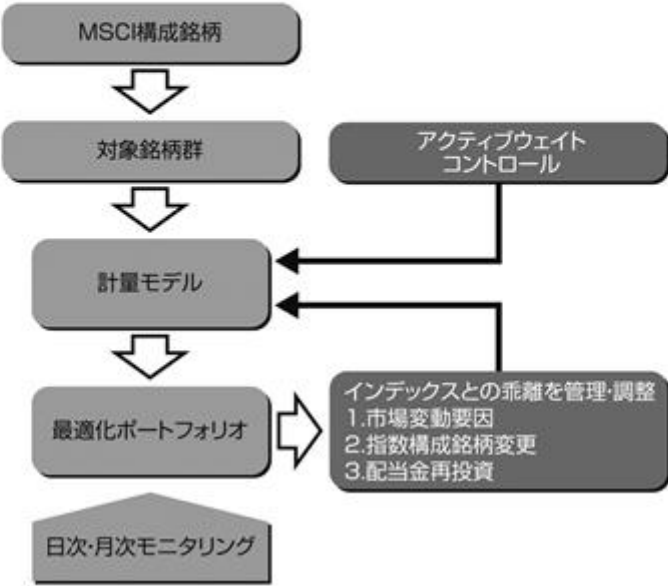
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変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	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式<sup>(*)</sup>に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージン・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</li><li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</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、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

	<p>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。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]          F[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     F --&gt; D          G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --&gt; C     G --&gt; D   </pre>
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. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>4. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券(*)を主要投資対象とします。 (*) 海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。



投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</li></ol>
------	--

S & P 先進国 R E I TインデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これの使用ライセンスがアセットマネジメントOne株式会社(以下「アセットマネジメントOne」)に付与されています。S&P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup>およびCDX<sup>®</sup>は、S&P Global, Inc.またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、アセットマネジメントOneにより一定の目的でサブライセンスされています。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)がスポンサーとなっておらず、推奨、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、証券全般または具体的に本商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 R E I Tインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに関する、S&P Dow Jones IndicesとアセットマネジメントOneとの間における唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesおよび/またはそのライセンサーの一定の商標、サービスマーク、および/または商号をライセンス供与していることです。S & P 先進国 R E I Tインデックスは、アセットマネジメントOneまたは本商品を考慮することなく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I Tインデックスの決定、構成または計算に際して、アセットマネジメントOneまたは本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資リターンを提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indicesは、(改正米国1940年投資会社法に定義する)投資顧問、商品取引顧問、コモディティ・プール・オペレーター、ブローカー・ディーラー、受認者、プロモーターでも、合衆国法典第15巻第77条k項(a)に列記する「専門家」でも、税務顧問でもありません。S&P Dow Jones Indicesが、証券、商品、暗号通貨又はその他資産を指数に採用した場合にも、それは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券、商品、暗号通貨またはその他の資産を購入、売却または保有するよう推奨したことにはならず、また投資助言もしくは商品取引の助言とはみなされません。S&P DOW JONES INDICESまたは第三者ライセンサーは、S & P 先進国 R E I Tインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面

	<p>の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&amp;P DOW JONES INDICESは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&amp;P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS &amp; P 先進国REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、アセットマネジメントOne、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られるべき結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&amp;P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&amp;P DOW JONES INDICESは、ライセンサーの商品の有価証券届出書、目論見書またはその他の募集資料を審査しておらず、いかなる部分も作成および/または証明しておらず、またS&amp;P DOW JONES INDICESはそれらを管理していません。S&amp;P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&amp;P DOW JONES INDICESとアセットマネジメントOneとの間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&amp;P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p> <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定]     B --&gt; C[ポートフォリオ]     C --&gt; D[日々・月次モニタリング]     D --&gt; E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本買動 4.設定/解約]     E --&gt; B   </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>3. 株式への直接投資は行いません。</li> <li>4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができます。</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	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>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<sup>(*)</sup>の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。 (*) 主要格付機関とは、R &amp; I、JCR、Moody's、S &amp; Pとします。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
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	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 株式への投資割合は、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。</li><li>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。</li><li>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。</li><li>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。</li><li>6. 外貨建て資産への投資は行いません。</li><li>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。</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>
--------	--

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6月28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6月、12月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

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、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める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。

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

#### (5) 【投資制限】

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)

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)

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)

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)

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

スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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21条)

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

#### 先物取引等の運用指図(約款第22条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の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。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券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有価証券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、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およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券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組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)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および組入貸付債権信託受益権の利払

金および償還金とマザーファンド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および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金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組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)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 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。)とマザーファンド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金融商品運用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マザーファンド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金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計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、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額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。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属す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(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

るヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)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、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の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。)とマザーファンド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金融商品運用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マザーファンド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金融商品運用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。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、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とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた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、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25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26条)

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

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28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、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の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の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。

#### 資金の借入れ(約款第35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 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### ・資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

#### ・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

#### ・為替リスク

為替ヘッジを行っても、為替相場の変動による基準価額への影響を完全には排除できません。

ファンドは、実質組入外貨建資産については原則として対円で為替ヘッジを行い為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。

なお、実質組入資産の直接ヘッジのほか、一部の新興国通貨については代替通貨を用いた為替ヘッジを行う場合があります。代替通貨を用いた為替ヘッジの場合、通貨間の値動きが異なる場

合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、代替通貨と一部の新興国通貨間の為替変動の影響を受ける可能性があります。

また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨および代替通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

・信用リスク

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

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、ファンドが実質的に投資するリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

各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。

各ファンドは、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。

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

(基本コース)(リスク抑制コース)の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

リスク抑制コースでは、過去12カ月間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に15%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)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(スイッチングのお申込みを含みます。)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。

各ファンドは、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、各ファンドにおいて受益権口数が10億口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

イ. ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)などの値動きのある有価証券(外貨建資産には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

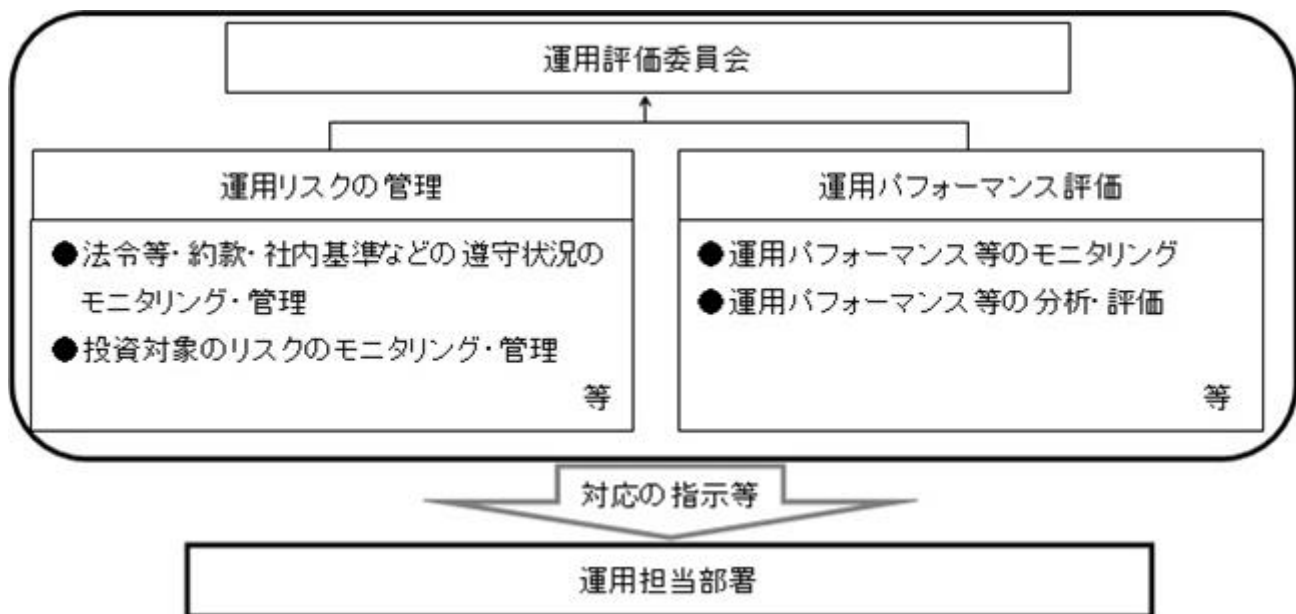
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、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。



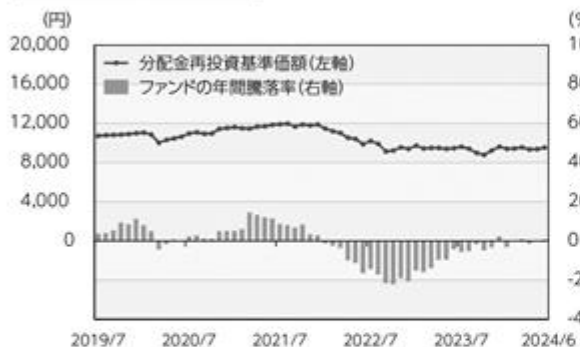
- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

リスク管理体制は2024年6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

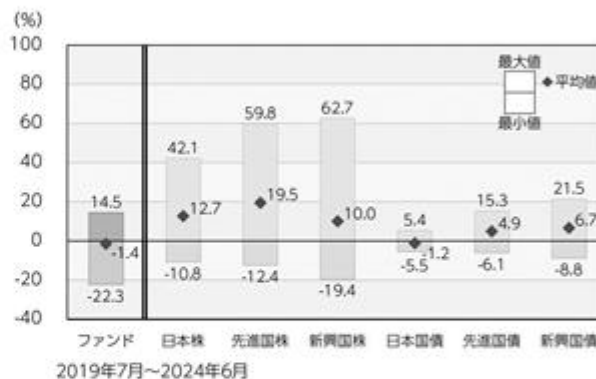
## <参考情報>

### 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

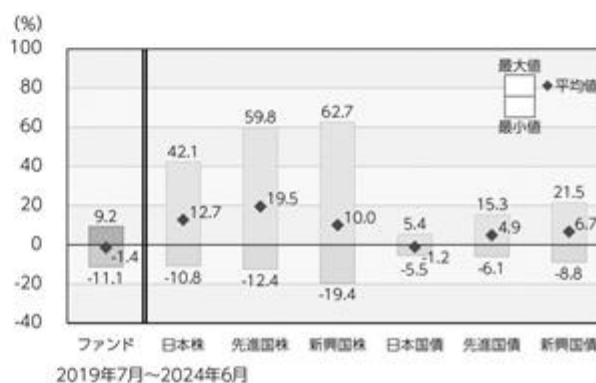
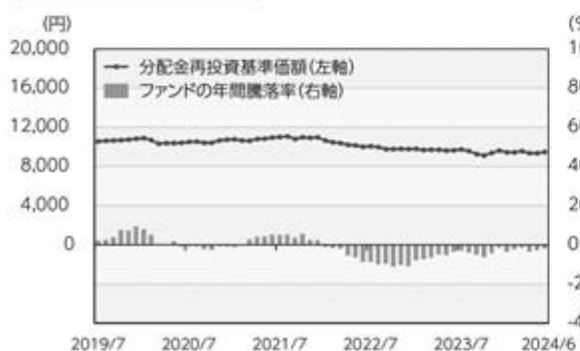
#### （基本コース）



### 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



#### （リスク抑制コース）



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

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

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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

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

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.243%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	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0.55%	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、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (4)【その他の手数料等】

###### 1. 信託財産留保額

ありません。

###### 2. その他の費用

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

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

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

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

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

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、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。

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2024年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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…

ファンド名	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
(基本コース)	1.35%	1.24%	0.11%
(リスク抑制コース)	1.31%	1.24%	0.07%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年12月12日~2024年6月11日

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

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

※なお、各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】

## ワールドアセットバランス(基本コース)

2024年6月28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	4,947,780,350	99.21
内 日本	4,947,780,350	99.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	39,443,900	0.79
純資産総額	4,987,224,250	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。

## ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2024年6月28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	14,806,145,256	99.88
内 日本	14,806,145,256	99.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,511,046	0.12
純資産総額	14,823,656,302	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)

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,580,740,220,668	96.35
内 アメリカ	1,166,353,326,771	71.09
内 イギリス	59,277,028,768	3.61
内 カナダ	50,829,329,568	3.10
内 スイス	46,885,877,034	2.86
内 フランス	44,017,895,220	2.68
内 ドイツ	36,427,272,294	2.22
内 オランダ	31,403,626,460	1.91
内 オーストラリア	29,023,712,982	1.77
内 アイルランド	27,398,532,422	1.67
内 デンマーク	16,943,518,676	1.03
内 スウェーデン	13,611,161,709	0.83
内 スペイン	10,887,139,939	0.66
内 イタリア	8,662,693,012	0.53
内 香港	5,866,528,314	0.36
内 ジャージー	4,732,089,363	0.29
内 シンガポール	4,535,710,721	0.28
内 フィンランド	4,194,583,070	0.26
内 ベルギー	3,245,838,491	0.20
内 イスラエル	3,107,926,031	0.19
内 ノルウェー	2,562,301,462	0.16
内 ケイマン諸島	2,086,891,761	0.13
内 パミュエダ	1,918,021,189	0.12
内 オランダ領キュラソー	1,709,947,191	0.10



	内 ニュージーランド	1,101,933,666	0.07
	内 リベリア	1,021,982,198	0.06
	内 オーストリア	810,474,370	0.05
	内 ルクセンブルグ	772,984,338	0.05
	内 ポルトガル	722,696,956	0.04
	内 パナマ	504,079,720	0.03
	内 マン島	125,116,972	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		2,315,946,056	0.14
	内 オーストラリア	1,950,139,159	0.12
	内 シンガポール	365,806,897	0.02
投資証券		26,926,581,318	1.64
	内 アメリカ	25,368,415,578	1.55
	内 フランス	565,140,527	0.03
	内 イギリス	529,916,329	0.03
	内 香港	253,820,792	0.02
	内 ベルギー	135,666,875	0.01
	内 カナダ	73,621,217	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		30,619,841,995	1.87
純資産総額		1,640,602,590,037	100.00

## その他資産の投資状況

2024年6月28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）	31,630,790,943	1.93
内 アメリカ	24,208,273,362	1.48
内 ドイツ	4,561,175,294	0.28
内 イギリス	1,271,180,256	0.08
内 カナダ	989,033,356	0.06
内 オーストラリア	601,128,675	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。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	247,399,139,689	101.07
内 アメリカ	117,252,651,684	47.90
内 中国	24,465,040,418	9.99
内 フランス	18,764,802,562	7.67
内 イタリア	17,472,517,180	7.14
内 ドイツ	15,222,712,091	6.22
内 イギリス	13,035,462,661	5.33
内 スペイン	11,579,290,013	4.73
内 カナダ	4,982,384,795	2.04
内 ベルギー	4,243,497,970	1.73
内 オランダ	3,608,929,647	1.47

内 オーストラリア	3,158,115,334	1.29
内 オーストリア	2,861,298,357	1.17
内 メキシコ	1,919,699,833	0.78
内 ポーランド	1,323,319,031	0.54
内 フィンランド	1,314,093,477	0.54
内 アイルランド	1,221,119,279	0.50
内 マレーシア	1,185,767,758	0.48
内 シンガポール	1,022,663,565	0.42
内 イスラエル	746,043,376	0.30
内 デンマーク	627,142,322	0.26
内 ニュージーランド	593,142,484	0.24
内 スウェーデン	400,860,729	0.16
内 ノルウェー	398,585,123	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,614,376,056	1.07
純資産総額	244,784,763,633	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。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	9,197,079,642	10.36
内 オーストラリア	6,486,183,633	7.31
内 シンガポール	2,664,687,079	3.00
内 香港	46,208,930	0.05
投資証券	78,534,811,344	88.50
内 アメリカ	68,655,824,521	77.37
内 イギリス	4,215,173,501	4.75
内 フランス	1,551,045,688	1.75
内 カナダ	1,208,393,967	1.36
内 ベルギー	903,838,519	1.02
内 香港	713,241,797	0.80
内 スペイン	369,814,774	0.42
内 ニュージーランド	239,860,290	0.27
内 ガーンジー	203,386,272	0.23
内 韓国	160,719,563	0.18
内 オランダ	155,950,950	0.18
内 イスラエル	91,669,351	0.10
内 ドイツ	32,122,189	0.04
内 アイルランド	27,528,530	0.03
内 イタリア	6,241,432	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,007,402,730	1.14
純資産総額	88,739,293,716	100.00

#### その他資産の投資状況

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	922,496,211	1.04
内 アメリカ	922,496,211	1.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	97,221,925,389	93.87
内 インド	18,922,934,304	18.27
内 台湾	18,527,411,119	17.89
内 ケイマン諸島	13,779,894,722	13.30
内 韓国	11,844,954,417	11.44
内 中国	9,962,340,977	9.62
内 ブラジル	4,053,283,053	3.91
内 サウジアラビア	3,836,623,966	3.70
内 南アフリカ	2,583,646,635	2.49
内 インドネシア	1,535,482,256	1.48
内 メキシコ	1,533,772,560	1.48
内 マレーシア	1,326,888,649	1.28
内 タイ	1,305,295,736	1.26
内 アラブ首長国連邦	1,077,435,539	1.04
内 ポーランド	862,838,916	0.83
内 香港	820,275,393	0.79
内 トルコ	774,277,785	0.75
内 カタール	773,372,282	0.75
内 クエート	719,947,538	0.70
内 フィリピン	506,482,896	0.49
内 ギリシャ	477,976,032	0.46
内 チリ	431,946,488	0.42
内 バミューダ	396,175,948	0.38
内 アメリカ	282,281,012	0.27
内 ハンガリー	233,860,329	0.23
内 イギリス	138,700,599	0.13
内 チェコ	128,954,388	0.12
内 ルクセンブルグ	119,383,685	0.12
内 コロンビア	100,691,577	0.10
内 エジプト	53,886,213	0.05
内 オランダ	52,174,325	0.05
内 ペルー	37,726,562	0.04
内 シンガポール	21,009,488	0.02
内 ロシア	0	0.00
内 キプロス	0	0.00
内 イギリス領バージン諸島	0	0.00
投資信託受益証券	593,427,525	0.57
内 メキシコ	439,771,245	0.42
内 ブラジル	153,656,280	0.15
投資証券	81,416,802	0.08
内 メキシコ	81,416,802	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,679,240,342	5.48
純資産総額	103,576,010,058	100.00

その他資産の投資状況

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,721,003,451	5.52
内 アメリカ	5,721,003,451	5.52

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	121,831,666,744	97.87
内 サウジアラビア	13,578,529,011	10.91
内 メキシコ	11,600,132,766	9.32
内 ポーランド	10,448,635,540	8.39
内 アラブ首長国連邦	10,151,637,598	8.16
内 ブラジル	8,946,921,367	7.19
内 チリ	8,210,762,177	6.60
内 ハンガリー	7,536,826,416	6.05
内 ドミニカ共和国	7,367,466,249	5.92
内 コロンビア	7,322,679,063	5.88
内 ルーマニア	5,807,172,517	4.67
内 カタール	5,532,358,427	4.44
内 パナマ	5,149,722,259	4.14
内 南アフリカ	5,126,208,461	4.12
内 インドネシア	4,083,206,667	3.28
内 ベルギー	3,926,908,265	3.15
内 オマーン	2,945,958,419	2.37
内 中国	1,450,456,134	1.17
内 フィリピン	1,339,766,971	1.08
内 ウルグアイ	1,306,318,437	1.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,650,310,865	2.13
純資産総額	124,481,977,609	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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2024年6月28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	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,730,651,620	1.1438 1,979,692,388	1.1526 1,994,749,057	- -	40.00

2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	445,245,322	1.8144 807,897,636	1.8831 838,441,465	- -	16.81
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	82,441,097	9.4101 775,787,210	9.7600 804,625,106	- -	16.13
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	314,205,372	2.4443 768,043,611	2.5318 795,505,160	- -	15.95
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	246,980,107	2.0280 500,900,355	2.0830 514,459,562	- -	10.32

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年6月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.21
合計	99.21

（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。

#### ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2024年6月28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	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,443,407,550	1.1448 6,232,008,298	1.1526 6,274,071,542	- -	42.32
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,264,883,932	1.8211 2,303,502,614	1.8831 2,381,902,932	- -	16.07
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	243,091,361	9.4381 2,294,325,214	9.7600 2,372,571,683	- -	16.01
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	897,659,054	2.4501 2,199,391,235	2.5318 2,272,693,192	- -	15.33
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	722,470,431	2.0315 1,467,762,821	2.0830 1,504,905,907	- -	10.15

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年6月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.88
合計	99.88

(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)

### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28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	1,126,785	66,040.56 74,413,513,301	72,940.54 82,188,317,068	- -	5.01
2	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,341,799	29,728.84 69,618,973,252	34,485.08 80,757,142,251	- -	4.92
3	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	3,991,150	12,181.01 48,616,244,995	19,971.06 79,707,533,236	- -	4.86
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,494,785	27,620.98 41,287,427,252	31,867.69 47,635,359,197	- -	2.90
5	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	349,927	76,293.64 26,697,206,386	83,685.52 29,283,826,176	- -	1.78
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	943,397	23,641.40 22,303,232,605	29,863.98 28,173,597,347	- -	1.72
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	812,939	23,809.02 19,355,286,682	30,097.54 24,467,464,232	- -	1.49
8	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	129,086	122,324.78 15,790,417,116	146,419.07 18,900,652,431	- -	1.15

9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	70,314	204,491.26 14,378,598,716	255,563.32 17,969,679,718	- -	1.10
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	458,314	28,465.24 13,046,020,164	32,080.31 14,702,856,068	- -	0.90
11	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	458,126	30,341.15 13,900,070,439	31,798.43 14,567,691,848	- -	0.89
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	209,434	64,304.28 13,467,504,421	65,708.50 13,761,595,350	- -	0.84
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	716,681	16,256.70 11,650,872,011	18,506.94 13,263,574,416	- -	0.81
14	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	521,540	19,635.81 10,240,861,837	23,160.05 12,078,897,692	- -	0.74
15	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	147,439	83,152.62 12,259,940,217	78,350.89 11,551,976,988	- -	0.70
16	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	252,905	44,687.09 11,301,590,307	42,939.65 10,859,652,512	- -	0.66
17	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	63,920	147,344.90 9,418,286,235	165,436.80 10,574,720,256	- -	0.64
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	375,540	25,126.46 9,435,991,562	26,837.48 10,078,548,516	- -	0.61
19	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	70,832	116,859.19 8,277,370,769	137,009.36 9,704,647,228	- -	0.59
20	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	133,233	74,857.41 9,973,477,892	71,313.74 9,501,343,854	- -	0.58
21	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	385,380	25,047.26 9,652,716,211	23,484.00 9,050,266,232	- -	0.55
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	158,472	57,602.35 9,128,361,076	55,003.79 8,716,561,290	- -	0.53
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	405,177	20,281.95 8,217,781,347	20,910.10 8,472,294,586	- -	0.52

24	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・ 小売り	707,614	9,099.45 6,438,905,161	10,933.43 7,736,649,268	- -	0.47
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	282,923	28,027.02 7,929,489,760	27,219.21 7,700,943,182	- -	0.47
26	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	69,251	93,555.64 6,478,822,168	110,226.64 7,633,305,309	- -	0.47
27	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,135,493	5,372.84 6,100,831,935	6,321.99 7,178,583,907	- -	0.44
28	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	426,961	17,319.28 7,394,658,405	16,499.50 7,044,647,203	- -	0.43
29	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	279,196	24,339.68 6,795,541,587	25,178.46 7,029,725,988	- -	0.43
30	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	652,436	9,568.19 6,242,636,661	10,293.98 6,716,165,549	- -	0.41

(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6月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.35
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.14
投資証券	1.64
合計	98.13

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2024年6月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
半導体・半導体製造装置	外国	9.68
ソフトウェア		8.84
コンピュータ・周辺機器		5.32
銀行		5.29
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.13
医薬品		5.02
石油・ガス・消耗燃料		4.14
大規模小売り		3.31
資本市場		3.04
保険		2.89
金融サービス		2.85
ヘルスケア機器・用品		2.09
航空宇宙・防衛		1.91
ホテル・レストラン・レジャー		1.84
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.80
機械	1.73	



バイオテクノロジー	1.72
生活必需品流通・小売り	1.72
化学	1.67
電力	1.53
専門小売り	1.51
自動車	1.44
飲料	1.37
金属・鉱業	1.30
食品	1.16
情報技術サービス	1.13
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.07
娯楽	1.07
電気設備	1.04
繊維・アパレル・贅沢品	1.03
家庭用品	1.00
陸上運輸	0.95
専門サービス	0.93
各種電気通信サービス	0.88
総合公益事業	0.66
通信機器	0.64
建設関連製品	0.61
コングロマリット	0.61
商業サービス・用品	0.60
パーソナルケア用品	0.55
メディア	0.53
タバコ	0.49
電子装置・機器・部品	0.48
商社・流通業	0.44
航空貨物・物流サービス	0.42
消費者金融	0.38
建設・土木	0.32
建設資材	0.30
家庭用耐久財	0.28
不動産管理・開発	0.26
エネルギー設備・サービス	0.22
無線通信サービス	0.21
容器・包装	0.20
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13
自動車用部品	0.10
運送インフラ	0.09
水道	0.08
紙製品・林産品	0.08
ガス	0.08
販売	0.07
ヘルスケア・テクノロジー	0.06
海上運輸	0.05
旅客航空輸送	0.04
各種消費者サービス	0.01
レジャー用品	0.00
合計	96.35

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28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 2.04 02/25/27 中国	国債証券	1,751,631,450	100.45 1,759,546,897	100.38 1,758,391,346	2.04 2027/2/25	0.72
2	US T N/B 4.625 03/15/26 アメリカ	国債証券	1,374,249,240	99.69 1,370,062,065	99.66 1,369,632,613	4.625 2026/3/15	0.56
3	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30 中国	国債証券	1,277,919,800	103.66 1,324,804,632	103.76 1,326,049,837	2.8 2030/3/25	0.54
4	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27 中国	国債証券	1,277,919,800	102.83 1,314,103,587	102.98 1,316,022,640	2.85 2027/6/4	0.54
5	CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34 中国	国債証券	1,288,936,350	100.65 1,297,331,579	100.92 1,300,904,124	2.35 2034/2/25	0.53
6	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,256,346,000	101.85 1,279,608,024	101.55 1,275,878,259	4.5 2033/11/15	0.52
7	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,240,239,000	99.11 1,229,217,342	98.84 1,225,874,513	4.125 2032/11/15	0.50
8	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29 中国	国債証券	1,101,655,000	101.53 1,118,519,024	101.64 1,119,753,979	2.37 2029/1/15	0.46
9	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 03/15/26 中国	国債証券	1,101,655,000	100.44 1,106,612,447	100.50 1,107,207,341	1.99 2026/3/15	0.45
10	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,220,910,600	89.71 1,095,361,882	89.45 1,092,190,372	2.75 2032/8/15	0.45
11	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,191,918,000	90.80 1,082,317,420	90.56 1,079,407,459	2.875 2032/5/15	0.44
12	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証券	1,068,605,350	100.79 1,077,078,108	100.89 1,078,128,760	2.18 2026/8/15	0.44
13	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	1,143,597,000	93.50 1,069,330,196	93.24 1,066,292,518	3.375 2033/5/15	0.44
14	US T N/B 2.375 04/30/26 アメリカ	国債証券	1,095,276,000	95.82 1,049,496,879	95.79 1,049,240,180	2.375 2026/4/30	0.43
15	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証券	1,030,848,000	97.99 1,010,150,508	97.71 1,007,251,248	4 2034/2/15	0.41
16	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	1,051,787,100	93.24 980,791,470	93.25 980,812,010	0.75 2026/3/31	0.40
17	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	936,406,750	101.00 945,791,699	101.12 946,923,908	2.3 2026/5/15	0.39
18	US T N/B 2.25 03/31/26 アメリカ	国債証券	966,420,000	95.75 925,384,898	95.72 925,120,640	2.25 2026/3/31	0.38

19	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	885,730,620	102.29 906,079,483	102.35 906,633,154	3.03 2026/3/11	0.37
20	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,109,772,300	81.31 902,383,601	81.17 900,866,330	0.875 2030/11/15	0.37
21	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,043,733,600	84.58 882,872,238	84.37 880,609,456	1.875 2032/2/15	0.36
22	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証券	837,257,800	101.92 853,375,180	101.99 853,947,696	2.69 2026/8/12	0.35
23	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	869,778,000	97.08 844,432,129	96.79 841,917,923	3.875 2033/8/15	0.34
24	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証券	873,321,540	94.41 824,572,459	94.41 824,504,226	1.625 2026/5/15	0.34
25	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	869,778,000	94.42 821,328,651	94.33 820,479,250	2.875 2028/8/15	0.34
26	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	869,778,000	94.52 822,161,054	94.25 819,850,706	3.5 2033/2/15	0.33
27	US T N/B 4.75 11/15/53 アメリカ	国債証券	777,968,100	105.93 824,159,955	105.31 819,297,655	4.75 2053/11/15	0.33
28	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49 中国	国債証券	649,976,450	125.05 812,849,108	125.86 818,072,384	3.86 2049/7/22	0.33
29	US T N/B 4.5 05/15/27 アメリカ	国債証券	805,350,000	100.02 805,570,214	99.94 804,878,113	4.5 2027/5/15	0.33
30	US T N/B 4.5 03/31/26 アメリカ	国債証券	805,350,000	99.51 801,433,357	99.48 801,197,414	4.5 2026/3/31	0.33

(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6月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	101.07
合計	101.07

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	375,795	17,621.86 6,622,208,927	17,935.14 6,739,937,627	- -	7.60
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	38,527	123,200.35 4,746,540,033	121,118.19 4,666,320,783	- -	5.26
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	242,746	16,480.31 4,000,529,667	16,646.58 4,040,891,801	- -	4.55

4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	132,344	23,543.21 3,115,803,707	24,129.89 3,193,447,048	- -	3.60
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	131,763	23,893.55 3,148,286,361	23,954.33 3,156,294,436	- -	3.56
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	353,583	8,560.49 3,026,843,957	8,444.90 2,985,973,112	- -	3.36
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	64,219	46,877.04 3,010,396,721	46,154.60 2,964,002,803	- -	3.34
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	701,835	3,838.27 2,693,835,283	3,689.35 2,589,321,975	- -	2.92
9	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	85,996	25,597.18 2,201,255,539	25,085.04 2,157,213,254	- -	2.43
10	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	423,769	4,525.98 1,917,972,731	4,579.22 1,940,531,522	- -	2.19
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	57,682	32,840.60 1,894,311,993	33,228.74 1,916,700,238	- -	2.16
12	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	119,096	14,312.32 1,704,540,528	14,369.05 1,711,296,938	- -	1.93
13	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	140,131	11,002.43 1,541,782,365	11,002.69 1,541,818,190	- -	1.74
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	164,514	8,120.61 1,335,954,175	8,183.96 1,346,377,097	- -	1.52
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	234,013	5,704.80 1,334,998,545	5,692.21 1,332,052,027	- -	1.50
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	63,982	18,773.46 1,201,163,622	18,746.93 1,199,466,542	- -	1.35
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	26,103	44,807.86 1,169,619,780	44,033.31 1,149,401,663	- -	1.30
18	MID AMERICA アメリカ	投資証券	47,500	22,702.56 1,078,371,787	22,636.77 1,075,246,945	- -	1.21
19	SEGRO PLC イギリス	投資証券	544,176	1,817.13 988,840,678	1,817.48 989,030,824	- -	1.11
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	50,686	18,929.86 959,479,016	19,338.06 980,169,122	- -	1.10
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	286,276	3,099.13 887,209,032	3,098.98 887,165,545	- -	1.00
22	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	286,832	2,951.88 846,694,404	2,902.48 832,524,544	- -	0.94
23	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	270,439	3,057.10 826,761,392	3,074.82 831,552,949	- -	0.94
24	UDR INC アメリカ	投資証券	123,264	6,558.48 808,424,982	6,566.82 809,452,981	- -	0.91
25	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	89,037	8,878.12 790,481,860	8,963.54 798,087,200	- -	0.90
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	75,885	10,363.38 786,425,346	10,511.42 797,659,728	- -	0.90

27	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	110,475	7,146.29 789,486,753	7,198.21 795,223,166	- -	0.90
28	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	129,991	5,854.89 761,083,590	5,920.93 769,668,027	- -	0.87
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	43,352	17,668.21 765,952,344	17,675.82 766,282,226	- -	0.86
30	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,114,281	341.25 721,501,465	332.76 703,569,288	- -	0.79

(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6月28日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.36
投資証券	88.50
合計	98.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,989,940	3,977.74 7,915,478,560	4,746.81 9,445,879,031	- -	9.12
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	534,100	6,237.39 3,331,391,342	7,723.87 4,125,320,035	- -	3.98
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	385,943	9,167.02 3,537,950,711	9,498.23 3,665,779,240	- -	3.54
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,258,968	1,402.83 1,766,130,669	1,476.07 1,858,333,079	- -	1.79

5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	245,849	5,683.52 1,397,289,570	5,938.53 1,459,982,645	- -	1.41
6	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	44,109	20,831.62 918,862,359	27,528.59 1,214,259,017	- -	1.17
7	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,008,195	727.52 733,485,491	1,050.72 1,059,338,211	- -	1.02
8	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小売り	48,325	18,424.16 890,347,847	21,251.57 1,026,982,400	- -	0.99
9	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	419,311	2,073.21 869,322,997	2,366.60 992,343,928	- -	0.96
10	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・レストラン・レジャー	410,610	2,016.46 827,979,342	2,345.63 963,139,544	- -	0.93
11	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,748,530	99.07 767,665,103	118.00 914,354,434	- -	0.88
12	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	122,945	5,214.70 641,121,691	6,897.71 848,039,816	- -	0.82
13	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	268,642	2,743.90 737,126,854	3,052.29 819,975,707	- -	0.79
14	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	226,901	2,928.70 664,527,215	3,290.53 746,624,774	- -	0.72
15	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	73,032	7,506.34 548,203,239	7,632.25 557,398,555	- -	0.54
16	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	158,927	3,455.80 549,220,317	3,506.12 557,218,722	- -	0.54
17	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信サービス	183,172	2,374.28 434,902,933	2,863.05 524,430,960	- -	0.51
18	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,371,200	67.92 432,787,076	78.39 499,463,852	- -	0.48
19	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	275,289	1,818.34 500,569,197	1,801.32 495,885,130	- -	0.48
20	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,252,235	83.16 436,800,887	94.27 495,175,988	- -	0.48

21	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	66,036	7,697.74 508,328,447	7,426.31 490,404,467	- -	0.47
22	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	156,600	2,909.17 455,576,374	3,100.68 485,567,897	- -	0.47
23	AXIS BANK LTD インド	株式 銀行	184,556	2,047.41 377,862,396	2,500.56 461,493,905	- -	0.45
24	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小 売り	14,368	27,916.73 401,107,593	31,020.52 445,702,946	- -	0.43
25	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	4,463,000	94.21 420,476,687	96.52 430,791,075	- -	0.42
26	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	384,212	1,163.56 447,057,174	1,103.44 423,956,281	- -	0.41
27	MAHINDRA & MAHINDRA LTD インド	株式 自動車	75,480	3,962.34 299,077,679	5,604.56 423,032,415	- -	0.41
28	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,238,800	336.31 416,622,297	341.22 422,703,583	- -	0.41
29	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	188,535	2,042.89 385,157,273	2,176.46 410,339,828	- -	0.40
30	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	544,000	628.79 342,066,512	741.64 403,456,784	- -	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年6月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	93.87
投資信託受益証券	0.57
投資証券	0.08
合計	94.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2024年6月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	15.71
半導体・半導体製造装置		12.61
コンピュータ・周辺機器		5.94
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.95
石油・ガス・消耗燃料		4.83
大規模小売り		3.90

金属・鉱業	3.54
自動車	3.17
電子装置・機器・部品	2.63
保険	2.51
情報技術サービス	2.09
ホテル・レストラン・レジャー	2.08
化学	1.96
電気設備	1.50
無線通信サービス	1.40
食品	1.39
不動産管理・開発	1.30
生活必需品流通・小売り	1.21
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	1.19
医薬品	1.17
コングロマリット	1.13
各種電気通信サービス	1.10
金融サービス	1.09
電力	1.05
飲料	0.99
娯楽	0.91
繊維・アパレル・贅沢品	0.73
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.73
バイオテクノロジー	0.69
機械	0.68
運送インフラ	0.68
消費者金融	0.68
建設資材	0.67
自動車用部品	0.66
パーソナルケア用品	0.66
資本市場	0.65
建設・土木	0.64
専門小売り	0.59
航空宇宙・防衛	0.50
旅客航空輸送	0.38
家庭用耐久財	0.35
海上運輸	0.34
ガス	0.34
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.32
タバコ	0.30
航空貨物・物流サービス	0.23
陸上運輸	0.23
通信機器	0.21
各種消費者サービス	0.20
ソフトウェア	0.17
紙製品・林産品	0.15
商社・流通業	0.14
ヘルスケア機器・用品	0.14
総合公益事業	0.10
水道	0.09
メディア	0.06



建設関連製品	0.06
エネルギー設備・サービス	0.05
家庭用品	0.05
商業サービス・用品	0.04
容器・包装	0.01
合計	93.87

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年6月28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	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証券	2,093,910,000	97.45 2,040,515,295	98.36 2,059,766,703	5.25 2029/6/16	1.65
2	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,932,840,000	103.68 2,004,040,027	105.68 2,042,778,006	7.125 2033/1/17	1.64
3	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証券	1,932,840,000	101.06 1,953,328,104	102.75 1,985,993,100	6.25 2032/9/22	1.60
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	1,932,840,000	100.62 1,944,882,237	102.37 1,978,748,815	5.5 2032/10/25	1.59
5	BRAZIL 3.75 09/12/31 ブラジル	国債証券	2,254,980,000	84.61 1,908,064,428	86.05 1,940,586,426	3.75 2031/9/12	1.56
6	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	2,093,910,000	88.96 1,862,782,120	91.58 1,917,686,010	4.85 2029/9/30	1.54
7	REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32 ポーランド	国債証券	1,771,770,000	102.28 1,812,246,891	103.96 1,842,012,707	5.75 2032/11/16	1.48
8	REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33 ポーランド	国債証券	1,771,770,000	96.16 1,703,848,069	97.97 1,735,865,080	4.875 2033/10/4	1.39
9	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,771,770,000	94.97 1,682,676,102	97.02 1,719,136,188	5.5 2029/2/22	1.38
10	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	2,254,980,000	70.61 1,592,405,991	75.13 1,694,177,748	5.75 2049/9/30	1.36
11	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,610,700,000	100.06 1,611,801,253	101.40 1,633,291,017	6.35 2035/2/9	1.31
12	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証券	1,803,984,000	88.74 1,600,877,468	90.15 1,626,308,713	3.25 2030/10/22	1.31
13	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28 サウジアラビア	国債証券	1,610,700,000	98.33 1,583,822,571	99.04 1,595,251,373	4.75 2028/1/18	1.28
14	REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53 ポーランド	国債証券	1,610,700,000	95.77 1,542,631,818	98.89 1,592,881,631	5.5 2053/4/4	1.28

15	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	1,610,700,000	96.20 1,549,599,706	97.47 1,570,039,891	4.375 2029/4/16	1.26
16	BRAZIL 6.0 10/20/33 ブラジル	国債証券	1,610,700,000	95.43 1,537,241,465	96.90 1,560,832,099	6 2033/10/20	1.25
17	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33 サウジアラビア	国債証券	1,932,840,000	77.96 1,506,909,713	80.11 1,548,545,503	2.25 2033/2/2	1.24
18	COLOMBIA 3.125 04/15/31 コロンビア	国債証券	1,932,840,000	78.04 1,508,489,017	79.36 1,533,943,360	3.125 2031/4/15	1.23
19	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,771,770,000	84.06 1,489,356,478	86.14 1,526,260,632	2.783 2031/1/23	1.23
20	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	1,449,630,000	100.73 1,460,286,391	101.72 1,474,661,123	6 2029/8/1	1.18
21	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	1,610,700,000	84.37 1,359,028,125	90.11 1,451,502,438	7.3 2052/4/20	1.17
22	REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34 チリ	国債証券	1,642,914,000	85.34 1,402,113,473	87.36 1,435,379,312	3.5 2034/1/31	1.15
23	REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34 ポーランド	国債証券	1,449,630,000	96.95 1,405,445,277	98.79 1,432,198,199	5.125 2034/9/18	1.15
24	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33 サウジアラビア	国債証券	1,449,630,000	95.84 1,389,364,532	97.90 1,419,227,634	4.875 2033/7/18	1.14
25	REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54 ポーランド	国債証券	1,449,630,000	95.83 1,389,281,903	97.88 1,418,930,460	5.5 2054/3/18	1.14
26	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,771,770,000	77.41 1,371,699,501	79.37 1,406,315,860	2.125 2031/9/22	1.13
27	ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31 アラブ首長国連邦	国債証券	1,610,700,000	81.12 1,306,677,153	82.70 1,332,151,179	1.875 2031/9/15	1.07
28	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証券	1,610,700,000	79.27 1,276,888,539	81.93 1,319,675,711	3 2034/1/15	1.06
29	HUNGARY 6.125 05/22/28 ハンガリー	国債証券	1,288,560,000	101.44 1,307,195,154	101.95 1,313,739,750	6.125 2028/5/22	1.06
30	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,449,630,000	87.75 1,272,112,504	88.84 1,287,862,947	3.875 2030/6/12	1.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年6月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.87
合計	97.87

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

ワールドアセットバランス（基本コース）

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

該当事項はありません。

（参考）

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

ワールドアセットバランス（基本コース）

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28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 Sep24	買建	542	24,090,997,489	24,208,273,362	1.48
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	536	4,551,344,729	4,561,175,294	0.28
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	76	1,271,972,810	1,271,180,256	0.08
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	32	977,016,594	989,033,356	0.06
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Sep24	買建	29	598,951,225	601,128,675	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	シカゴ商品取引所	DJ US REAL ESTATE Sep24	買建	170	923,200,086	922,496,211	1.04

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

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

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep24	買建	654	5,707,610,481	5,721,003,451	5.52

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

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

#### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

#### ワールドアセットバランス（基本コース）

直近日（2024年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
第2計算期間末 (2017年12月11日)	13,684	13,684	1.0542	1.0542
第3計算期間末 (2018年6月11日)	16,409	16,409	1.0376	1.0376
第4計算期間末 (2018年12月11日)	14,083	14,083	1.0007	1.0007
第5計算期間末 (2019年6月11日)	12,878	12,878	1.0565	1.0565
第6計算期間末 (2019年12月11日)	12,003	12,003	1.0853	1.0853
第7計算期間末 (2020年6月11日)	11,343	11,343	1.0724	1.0724
第8計算期間末 (2020年12月11日)	10,467	10,467	1.1486	1.1486
第9計算期間末 (2021年6月11日)	9,706	9,706	1.1869	1.1869

第10計算期間末 (2021年12月13日)	8,589	8,589	1.1896	1.1896
第11計算期間末 (2022年6月13日)	6,748	6,748	1.0025	1.0025
第12計算期間末 (2022年12月12日)	6,104	6,104	0.9632	0.9632
第13計算期間末 (2023年6月12日)	5,766	5,766	0.9493	0.9493
第14計算期間末 (2023年12月11日)	5,315	5,315	0.9319	0.9319
第15計算期間末 (2024年6月11日)	5,018	5,018	0.9453	0.9453
2023年6月末日	5,729	-	0.9474	-
7月末日	5,704	-	0.9606	-
8月末日	5,534	-	0.9398	-
9月末日	5,254	-	0.9001	-
10月末日	5,072	-	0.8787	-
11月末日	5,288	-	0.9246	-
12月末日	5,444	-	0.9622	-
2024年1月末日	5,265	-	0.9418	-
2月末日	5,211	-	0.9432	-
3月末日	5,233	-	0.9571	-
4月末日	5,055	-	0.9353	-
5月末日	4,997	-	0.9386	-
6月末日	4,987	-	0.9527	-

## ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

直近日(2024年6月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	10,386	10,386	1.0337	1.0337
第2計算期間末 (2017年12月11日)	47,243	47,243	1.0544	1.0544
第3計算期間末 (2018年6月11日)	64,853	64,853	1.0356	1.0356
第4計算期間末 (2018年12月11日)	53,883	53,883	0.9975	0.9975
第5計算期間末 (2019年6月11日)	49,438	49,438	1.0392	1.0392
第6計算期間末 (2019年12月11日)	46,310	46,310	1.0681	1.0681
第7計算期間末 (2020年6月11日)	41,188	41,188	1.0437	1.0437
第8計算期間末 (2020年12月11日)	36,032	36,032	1.0685	1.0685
第9計算期間末 (2021年6月11日)	30,943	30,943	1.0971	1.0971

第10計算期間末 (2021年12月13日)	26,061	26,061	1.0983	1.0983
第11計算期間末 (2022年6月13日)	22,061	22,061	1.0041	1.0041
第12計算期間末 (2022年12月12日)	20,162	20,162	0.9801	0.9801
第13計算期間末 (2023年6月12日)	18,479	18,479	0.9676	0.9676
第14計算期間末 (2023年12月11日)	16,231	16,231	0.9411	0.9411
第15計算期間末 (2024年6月11日)	14,860	14,860	0.9393	0.9393
2023年6月末日	18,267	-	0.9647	-
7月末日	18,217	-	0.9736	-
8月末日	17,740	-	0.9554	-
9月末日	16,997	-	0.9255	-
10月末日	16,364	-	0.9118	-
11月末日	16,219	-	0.9366	-
12月末日	16,405	-	0.9614	-
2024年1月末日	15,941	-	0.9450	-
2月末日	15,664	-	0.9450	-
3月末日	15,711	-	0.9567	-
4月末日	15,103	-	0.9340	-
5月末日	14,806	-	0.9343	-
6月末日	14,823	-	0.9458	-

## 【分配の推移】

## ワールドアセットバランス(基本コース)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

## ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

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

第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## ワールドアセットバランス（基本コース）

	収益率（％）
第1計算期間	3.4
第2計算期間	1.9
第3計算期間	1.6
第4計算期間	3.6
第5計算期間	5.6
第6計算期間	2.7
第7計算期間	1.2
第8計算期間	7.1
第9計算期間	3.3
第10計算期間	0.2
第11計算期間	15.7
第12計算期間	3.9
第13計算期間	1.4
第14計算期間	1.8
第15計算期間	1.4

（注）収益率は期間騰落率です。

## ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

	収益率（％）
第1計算期間	3.4
第2計算期間	2.0
第3計算期間	1.8
第4計算期間	3.7
第5計算期間	4.2
第6計算期間	2.8
第7計算期間	2.3
第8計算期間	2.4
第9計算期間	2.7
第10計算期間	0.1
第11計算期間	8.6
第12計算期間	2.4
第13計算期間	1.3
第14計算期間	2.7

第15計算期間	0.2
---------	-----

(注) 収益率は期間騰落率です。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

##### ワールドアセットバランス(基本コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,868,621,462	62,212,876
第2計算期間	7,912,713,431	738,193,959
第3計算期間	4,414,882,467	1,581,611,324
第4計算期間	527,482,147	2,267,181,143
第5計算期間	180,523,898	2,065,395,074
第6計算期間	287,056,004	1,416,879,908
第7計算期間	213,369,846	696,011,702
第8計算期間	122,826,944	1,586,765,325
第9計算期間	227,608,795	1,163,074,115
第10計算期間	159,562,024	1,117,350,709
第11計算期間	48,454,636	537,462,741
第12計算期間	34,334,302	427,232,156
第13計算期間	46,465,749	310,561,024
第14計算期間	20,220,258	389,917,952
第15計算期間	12,709,017	408,309,790

(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。

##### ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569
第3計算期間	23,144,363,900	5,324,740,324
第4計算期間	2,278,919,156	10,886,978,597
第5計算期間	226,859,362	6,670,815,337
第6計算期間	398,143,626	4,613,079,433
第7計算期間	284,570,545	4,182,089,512
第8計算期間	108,436,378	5,849,150,571
第9計算期間	107,132,818	5,624,497,695
第10計算期間	92,831,691	4,569,076,002
第11計算期間	36,964,114	1,793,363,306
第12計算期間	25,965,966	1,426,678,849
第13計算期間	23,048,616	1,495,063,349
第14計算期間	36,750,716	1,888,596,359
第15計算期間	15,987,652	1,442,608,414

(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。

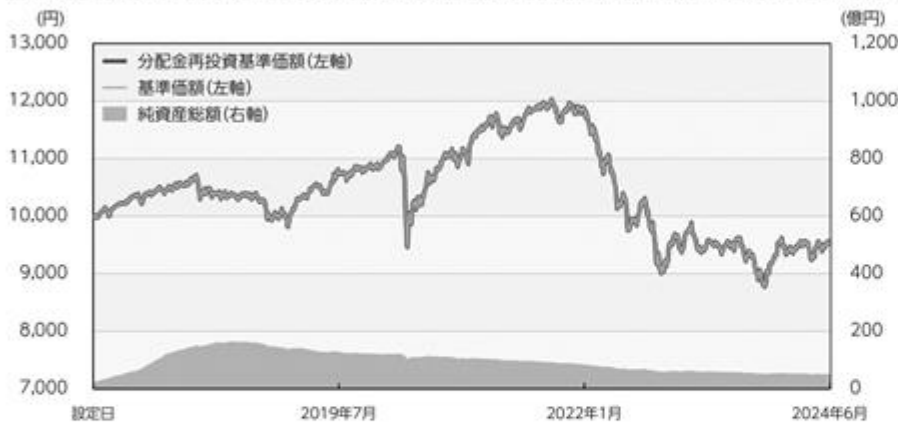


&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2024年6月28日

## (基本コース)

## 基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2024年6月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2017年1月18日)

## 分配の推移(税引前)

2022年 6月	0円
2022年 12月	0円
2023年 6月	0円
2023年 12月	0円
2024年 6月	0円
設定来累計	0円

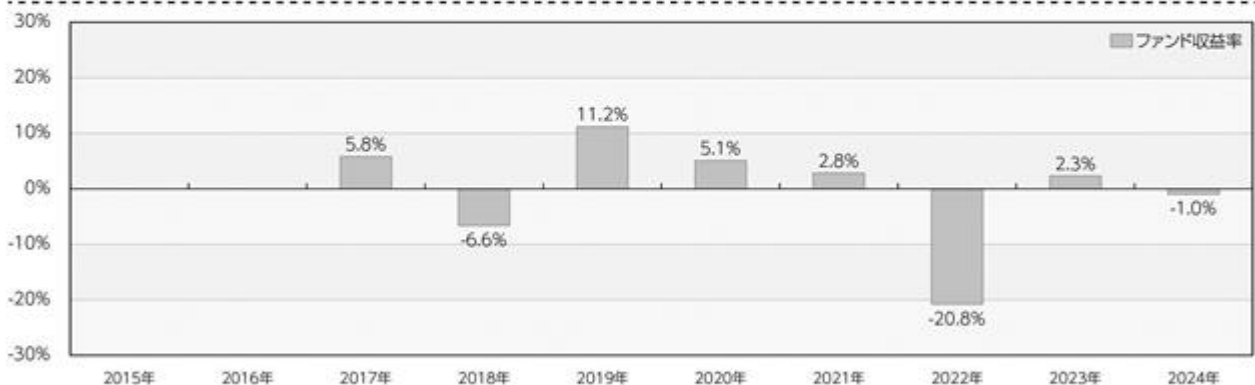
※分配金は1万口当たりです。

## 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	種類	国/地域	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	40.00
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	16.81
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	16.13
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	15.95
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.32

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および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。

データの基準日:2024年6月28日

(リスク抑制コース)

## 基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2024年6月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2017年1月18日)

## 分配の推移(税引前)

2022年 6月	0円
2022年12月	0円
2023年 6月	0円
2023年12月	0円
2024年 6月	0円
設定来累計	0円

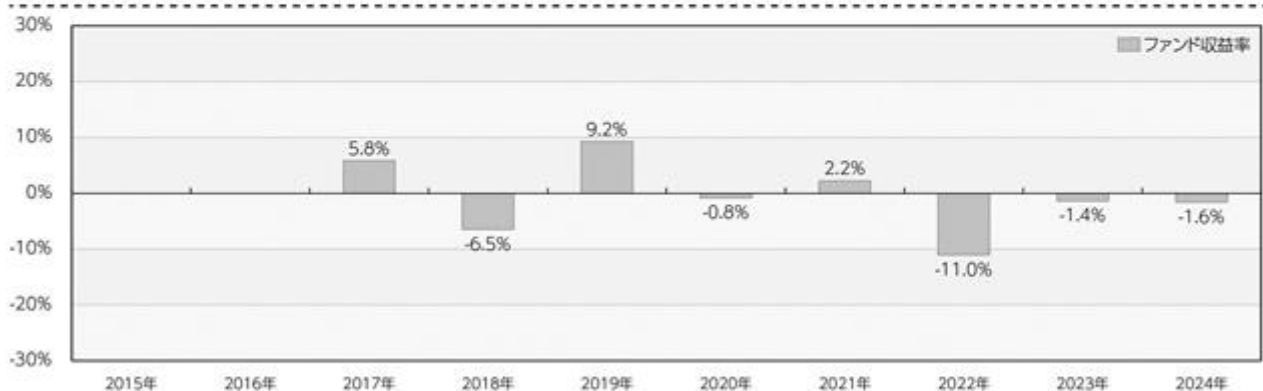
※分配金は1万口当たりです。

## 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	種類	国/地域	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	42.32
2	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	16.07
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	16.01
4	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	15.33
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.15

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および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。

データの基準日:2024年6月28日

## 主要な資産の状況

### ■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	5.01
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.92
3	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.86
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売	2.90
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	1.78

### ■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27	国債証券	中国	2.04	2027/2/25	0.72
2	US T N/B 4.625 03/15/26	国債証券	アメリカ	4.625	2026/3/15	0.56
3	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	国債証券	中国	2.8	2030/3/25	0.54
4	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	中国	2.85	2027/6/4	0.54
5	CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	国債証券	中国	2.35	2034/2/25	0.53

### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	7.60
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.26
3	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	4.55
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.60
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.56

### ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	9.12
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.98
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.54
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売	1.79
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.41

○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6月28日

## ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	HUNGARY 5.25 06/16/29	国債証券	ハンガリー	5.25	2029/6/16	1.65
2	ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	ルーマニア	7.125	2033/1/17	1.64
3	HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	ハンガリー	6.25	2032/9/22	1.60
4	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	国債証券	サウジアラビア	5.5	2032/10/25	1.59
5	BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	ブラジル	3.75	2031/9/12	1.56

---

○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。

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

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

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が完了したものを当日のお申込みとします。

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得のお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付を中止することおよびすでに受付けた取得のお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付を取り消すことができるものとします。

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

各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、2.2%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、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、

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

#### ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

#### ・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

#### ・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

## &lt; 主な投資対象の時価評価方法の原則 &gt;

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は、2017年1月18日（設定日）から原則として2027年6月11日までです。

下記(5)その他 イ. の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。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たと  
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6月12日から12月11日まで、および12月12日から翌年6月11日までと  
します。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当  
日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ



り次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## (5)【その他】

### イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信

託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### ロ. 信託約款の変更等

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

#### ハ. 関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半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、毎年6月11日、12月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。

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

## 4【受益者の権利等】

### 収益分配金請求権

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

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

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

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

#### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

#### 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。

#### 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】

ワールドアセットバランス(基本コース)

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2023年12月12日から2024年6月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【ワールドアセットバランス(基本コース)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 2023年12月11日現在	第15期 2024年6月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	208,257	229,025
コール・ローン	141,926,295	153,913,001
親投資信託受益証券	5,169,013,521	4,901,822,979
派生商品評価勘定	48,261,937	2,798,027
流動資産合計	5,359,410,010	5,058,763,032
資産合計	5,359,410,010	5,058,763,032
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,787,915
未払解約金	9,771,157	2,312,180
未払受託者報酬	893,715	859,549
未払委託者報酬	32,771,572	31,518,455
その他未払費用	105,970	101,915
流動負債合計	43,542,414	40,580,014
負債合計	43,542,414	40,580,014
純資産の部		
元本等		
元本	5,704,271,955	5,308,671,182
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	388,404,359	290,488,164
(分配準備積立金)	988,370,880	968,362,246
元本等合計	5,315,867,596	5,018,183,018
純資産合計	5,315,867,596	5,018,183,018
負債純資産合計	5,359,410,010	5,058,763,032

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 自 2023年6月13日 至 2023年12月11日	第15期 自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	523,540	-
受取利息	163,031	21,214
有価証券売買等損益	160,499,069	432,509,458
為替差損益	233,068,217	322,747,962
営業収益合計	71,882,577	109,782,710
<b>営業費用</b>		
支払利息	28,785	2,883
受託者報酬	893,715	859,549
委託者報酬	32,771,572	31,518,455
その他費用	1,287,231	1,386,192
営業費用合計	34,981,303	33,767,079
営業利益又は営業損失( )	106,863,880	76,015,631
経常利益又は経常損失( )	106,863,880	76,015,631
当期純利益又は当期純損失( )	106,863,880	76,015,631
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( )	7,958,175	5,187,582
期首剰余金又は期首欠損金( )	307,813,741	388,404,359
剰余金増加額又は欠損金減少額	19,766,767	27,794,764
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	19,766,767	27,794,764
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,451,680	706,618
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	1,451,680	706,618
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	388,404,359	290,488,164

## (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15期	
	自 2023年12月12日	至 2024年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第14期	第15期
	2023年12月11日現在	2024年6月11日現在
1. 期首元本額	6,073,969,649円	5,704,271,955円
期中追加設定元本額	20,220,258円	12,709,017円
期中一部解約元本額	389,917,952円	408,309,790円
2. 受益権の総数	5,704,271,955口	5,308,671,182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388,404,359円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は290,488,164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14期	第15期
	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(45,464,598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(213,367,392円)及び分配準備積立金(942,906,282円)より分配対象収益は1,201,738,272円(1万口当たり2,106.73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(50,649,995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(200,700,188円)及び分配準備積立金(917,712,251円)より分配対象収益は1,169,062,434円(1万口当たり2,202.17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14期	第15期
	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期	第15期
	2023年12月11日現在	2024年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（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>	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。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。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第14期 2023年12月11日現在	第15期 2024年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	144,769,117	370,588,442
合計	144,769,117	370,588,442

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	第14期 2023年12月11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	3,009,404,853	-	2,961,142,916	48,261,937
アメリカ・ドル	2,469,167,108	-	2,431,734,600	37,432,508
イギリス・ポンド	63,155,714	-	61,747,400	1,408,314
イスラエル・シェケル	1,577,470	-	1,562,696	14,774
オーストラリア・ドル	52,523,640	-	51,402,600	1,121,040
カナダ・ドル	35,810,742	-	35,151,600	659,142
シンガポール・ドル	20,922,990	-	20,510,500	412,490
スイス・フラン	23,626,148	-	23,108,400	517,748

スウェーデン・クローナ	7,721,560	-	7,612,000	109,560
デンマーク・クローネ	7,963,251	-	7,744,100	219,151
ニュージーランド・ドル	1,813,120	-	1,771,800	41,320
ノルウェー・クローネ	1,634,880	-	1,594,800	40,080
メキシコ・ペソ	19,659,510	-	19,370,520	288,990
ユーロ	104,272,350	-	101,387,000	2,885,350
香港・ドル	175,487,970	-	172,884,900	2,603,070
南アフリカ・ランド	24,068,400	-	23,560,000	508,400
合計	3,009,404,853	-	2,961,142,916	48,261,937

種類	第15期 2024年6月11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				
アメリカ・ドル	2,806,912,853	-	2,809,902,741	2,989,888
イギリス・ポンド	2,307,096,175	-	2,312,121,500	5,025,325
イスラエル・シェケル	59,850,900	-	59,867,400	16,500
オーストラリア・ドル	1,271,919	-	1,256,361	15,558
オーストラリア・ドル	54,240,680	-	53,865,760	374,920
カナダ・ドル	32,201,036	-	31,903,200	297,836
シンガポール・ドル	18,559,952	-	18,553,280	6,672
スイス・フラン	20,905,200	-	21,023,040	117,840
スウェーデン・クローナ	6,707,250	-	6,732,000	24,750
デンマーク・クローネ	7,981,400	-	7,928,200	53,200
ニュージーランド・ドル	1,925,400	-	1,921,160	4,240
ノルウェー・クローネ	1,343,025	-	1,325,880	17,145
メキシコ・ペソ	18,357,000	-	16,961,400	1,395,600
ユーロ	95,215,736	-	94,582,880	632,856
香港・ドル	160,132,000	-	160,672,000	540,000
南アフリカ・ランド	21,125,180	-	21,188,680	63,500
合計	2,806,912,853	-	2,809,902,741	2,989,888

## (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)

	第14期 2023年12月11日現在	第15期 2024年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9319円 (9,319円)	0.9453円 (9,453円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2024年6月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	82,441,097	775,787,210	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	246,980,107	500,900,355	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,791,410,235	2,049,194,167	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	445,245,322	807,897,636	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	314,205,372	768,043,611	
親投資信託受益証券 合計		2,880,282,133	4,901,822,979	
合計			4,901,822,979	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 【ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 2023年12月11日現在	第15期 2024年6月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	240,080	263,458
コール・ローン	6,470,073,288	2,031,268,912
親投資信託受益証券	9,799,977,806	12,937,990,182
派生商品評価勘定	85,694,974	6,797,662
流動資産合計	16,355,986,148	14,976,320,214
資産合計	16,355,986,148	14,976,320,214
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	47,082	16,757,182
未払解約金	16,535,093	1,752,443
未払受託者報酬	2,850,918	2,580,349
未払委託者報酬	104,535,410	94,614,429
その他未払費用	338,218	306,119
流動負債合計	124,306,721	116,010,522
負債合計	124,306,721	116,010,522
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,247,082,852	15,820,462,090
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,015,403,425	960,152,398
(分配準備積立金)	1,192,655,935	1,174,662,193
元本等合計	16,231,679,427	14,860,309,692
純資産合計	16,231,679,427	14,860,309,692
負債純資産合計	16,355,986,148	14,976,320,214

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 自 2023年6月13日 至 2023年12月11日	第15期 自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	806,963	-
受取利息	272,255	363,694
有価証券売買等損益	204,745,387	855,212,376
為替差損益	603,351,555	779,106,207
営業収益合計	397,526,950	76,469,863
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,056,670	128,520
受託者報酬	2,850,918	2,580,349
委託者報酬	104,535,410	94,614,429
その他費用	2,169,931	1,898,910
営業費用合計	110,612,929	99,222,208
営業利益又は営業損失( )	508,139,879	22,752,345
経常利益又は経常損失( )	508,139,879	22,752,345
当期純利益又は当期純損失( )	508,139,879	22,752,345
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( )	52,889,463	6,037,275
期首剰余金又は期首欠損金( )	619,407,574	1,015,403,425
剰余金増加額又は欠損金減少額	61,282,286	84,927,891
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	61,282,286	84,927,891
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,027,721	887,244
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	2,027,721	887,244
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,015,403,425	960,152,398

## （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15期	
	自 2023年12月12日	至 2024年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第14期	第15期
	2023年12月11日現在	2024年6月11日現在
1. 期首元本額	19,098,928,495円	17,247,082,852円
期中追加設定元本額	36,750,716円	15,987,652円
期中一部解約元本額	1,888,596,359円	1,442,608,414円
2. 受益権の総数	17,247,082,852口	15,820,462,090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1,015,403,425円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は960,152,398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14期	第15期
	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（65,217,740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（498,210,338円）及び分配準備積立金（1,127,438,195円）より分配対象収益は1,690,866,273円（1万口当たり980.37円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（81,716,831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（458,073,689円）及び分配準備積立金（1,092,945,362円）より分配対象収益は1,632,735,882円（1万口当たり1,032.04円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期	第15期
	自 2023年6月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期	第15期
	2023年12月11日現在	2024年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左



2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載していません。</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>	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。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。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第14期 2023年12月11日現在	第15期 2024年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	189,122,793	654,309,096
合計	189,122,793	654,309,096

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	第14期 2023年12月11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				
アメリカ・ドル	5,753,421,430	-	5,667,773,538	85,647,892
イギリス・ポンド	4,747,698,424	-	4,681,197,600	66,500,824
イスラエル・シェケル	120,530,985	-	118,046,500	2,484,485
イスラエル・シェケル	2,760,572	-	2,734,718	25,854
オーストラリア・ドル	95,320,680	-	93,286,200	2,034,480
カナダ・ドル	64,025,266	-	62,846,800	1,178,466
シンガポール・ドル	38,542,350	-	37,782,500	759,850
スイス・フラン	40,501,968	-	39,614,400	887,568

スウェーデン・クローナ	13,477,632	-	13,286,400	191,232
デンマーク・クローネ	13,989,495	-	13,604,500	384,995
ニュージーランド・ドル	3,626,240	-	3,543,600	82,640
ノルウェー・クローネ	2,861,040	-	2,790,900	70,140
メキシコ・ペソ	34,362,135	-	33,857,020	505,115
ユーロ	198,519,303	-	193,415,200	5,104,103
香港・ドル	335,124,460	-	330,575,200	4,549,260
南アフリカ・ランド	42,080,880	-	41,192,000	888,880
合計	5,753,421,430	-	5,667,773,538	85,647,892

種類	第15期 2024年6月11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				
アメリカ・ドル	7,112,440,396	-	7,122,399,916	9,959,520
イギリス・ポンド	5,879,062,156	-	5,893,950,400	14,888,244
イスラエル・シケル	151,580,608	-	151,664,080	83,472
オーストラリア・ドル	2,967,811	-	2,931,509	36,302
カナダ・ドル	136,591,464	-	135,700,280	891,184
シンガポール・ドル	78,202,516	-	77,479,200	723,316
シンガポール・ドル	42,919,889	-	42,904,460	15,429
スイス・フラン	48,778,800	-	49,053,760	274,960
スウェーデン・クローナ	16,097,400	-	16,156,800	59,400
デンマーク・クローネ	19,155,360	-	19,027,680	127,680
ニュージーランド・ドル	4,813,500	-	4,802,900	10,600
ノルウェー・クローネ	3,282,950	-	3,241,040	41,910
メキシコ・ペソ	44,148,585	-	40,792,167	3,356,418
ユーロ	249,872,027	-	248,280,060	1,591,967
香港・ドル	384,316,800	-	385,612,800	1,296,000
南アフリカ・ランド	50,650,530	-	50,802,780	152,250
合計	7,112,440,396	-	7,122,399,916	9,959,520

## (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）

	第14期 2023年12月11日現在	第15期 2024年6月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9411円 (9,411円)	0.9393円 (9,393円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2024年6月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	216,342,396	2,035,825,214	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	642,800,070	1,303,662,821	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,962,853,657	5,677,008,298	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,069,331,835	1,940,302,614	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	810,502,060	1,981,191,235	
親投資信託受益証券 合計		7,701,830,018	12,937,990,182	
合計			12,937,990,182	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

「ワールドアセットバランス（基本コース）」、「ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）」は、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 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6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	15,993,148,573
コール・ローン	1,360,849,235
株式	1,507,871,804,598
投資信託受益証券	2,340,694,017
投資証券	25,911,291,611
派生商品評価勘定	346,470,539
未収入金	12,503,936
未収配当金	2,190,908,804
差入委託証拠金	12,210,429,262
流動資産合計	1,568,238,100,575
資産合計	1,568,238,100,575
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,234,965
未払解約金	88,258,000
流動負債合計	136,492,965
負債合計	136,492,965
純資産の部	
元本等	
元本	166,637,793,374
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,401,463,814,236
元本等合計	1,568,101,607,610
純資産合計	1,568,101,607,610
負債純資産合計	1,568,238,100,575

## 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12月12日 至 2024年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	160,230,183,976円
同期中追加設定元本額	19,255,373,890円
同期中一部解約元本額	12,847,764,492円

## 元本の内訳

## ファンド名

DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,756,505,618円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,481,581円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	6,804,448円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	17,190,559円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	19,433,735円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,395,795円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,467,188円
たわらノーロード 先進国株式	63,392,770,726円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,723,985,344円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	926,117,070円
たわらノーロード バランス(堅実型)	74,868,776円
たわらノーロード バランス(標準型)	735,427,576円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,039,514,512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)	30,145,104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)	194,048,337円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	242,946,578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)	428,202,790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)	114,463円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	12,139,396円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,173,837円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,993,687円
たわらノーロード 全世界株式	4,082,262,423円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	57,876,634,136円
One DC 先進国株式インデックスファンド	3,567,551,165円
Oneグローバルバランス	34,591,168円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	118,020,395円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	717,968,648円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	975,128,138円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	63,043,749円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	192,073,173円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	212,370,757円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	16,139,878円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	605,955,973円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	111,796,003円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	133,355,786円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	173,690,483円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	299,554,673円
投資のソムリエ	8,224,391,545円
クルーズコントロール	67,824,657円
投資のソムリエ<DC年金>	873,206,782円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	192,254,263円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	314,003,342円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	505,512,874円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,549,237,846円
ワールドアセットバランス(基本コース)	82,441,097円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	216,342,396円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	59,259,785円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	30,730,761円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,689,260円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	186,773,520円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	139,796,988円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	368,686,850円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	112,204,736円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	66,194,589円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	32,876,163円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	20,152,824円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	156,649,301円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,092,433円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	22,795,876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)	3,722,750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)	3,751,424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)	26,665,619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)	2,240,951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)	9,543,223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)	5,504,812円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	2,638,085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)	18,340,098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)	3,725,648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)	332,557,367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)	34,305,741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)	975,556,381円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,040,839,019円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	131,071,709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)	233,994円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	4,700,190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)	6,227,529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)	4,768,385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)	17,197,769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)	35,018,005円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,289,796円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,319,548円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	760,384円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,066円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	272,768円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,337,520円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	84,642,793円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	168,082,600円

D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	598,354,769円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A ( 適格機関投資家限定 )	24,967,948円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 ( 適格機関投資家限定 )	20,084,734円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	132,992,192円
D I A M世界アセットバランスファンドV A ( 適格機関投資家向け )	4,347,952円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	119,285円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A ( 適格機関投資家限定 )	44,179,165円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	3,853,513円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	17,489,931円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A ( 適格機関投資家限定 )	29,669,296円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A ( 適格機関投資家限定 )	62,981,385円
動的パッケージファンド< D C年金 >	12,312,594円
コア資産形成ファンド	5,833,069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>	2,069,491,791円
M H A M外国株式インデックスファンド	130,631,338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>	981,348,550円
M H A M動的パッケージファンド[ 適格機関投資家限定 ]	1,391,721,191円
M H A M外国株式パッシブファンド[ 適格機関投資家限定 ]	2,117,853,112円
計	166,637,793,374円
2. 受益権の総数	166,637,793,374口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項



項目	2024年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	96,395,818,786
投資信託受益証券	200,441,077
投資証券	151,110,591
合計	96,747,370,454

(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(2024年2月16日から2024年6月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年6月11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	58,902,060	-	59,070,888	168,828
イギリス・ポンド	58,902,060	-	59,070,888	168,828
買建	1,373,455,273	-	1,375,831,359	2,376,086
アメリカ・ドル	1,026,475,200	-	1,028,446,324	1,971,124
イギリス・ポンド	19,419,594	-	19,420,437	843
オーストラリア・ドル	38,259,296	-	38,436,812	177,516
カナダ・ドル	42,088,766	-	42,170,460	81,694
ユーロ	247,212,417	-	247,357,326	144,909
合計	1,432,357,333	-	1,434,902,247	2,207,258

## (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。

#### 株式関連

種類	2024年6月11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	31,697,008,700	-	31,993,037,016	296,028,316
合計	31,697,008,700	-	31,993,037,016	296,028,316

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年6月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	9.4102円 (94,102円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### （1）株式

2024年6月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,478,157	187.060	276,504,048.420	
	ABBOTT LABORATORIES	271,533	107.490	29,187,082.170	
	AES CORP	109,122	20.380	2,223,906.360	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	145,341	170.380	24,763,199.580	
	ADVANCED MICRO DEVICES	256,143	160.340	41,069,968.620	
	ADOBE INC	70,709	459.940	32,521,897.460	

CHUBB LTD	64,580	267.690	17,287,420.200	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	35,944	282.310	10,147,350.640	
ALLSTATE CORP	41,541	163.810	6,804,831.210	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	103,007	210.740	21,707,695.180	
AMGEN INC	83,769	304.720	25,526,089.680	
HESS CORP	44,111	147.810	6,520,046.910	
AMERICAN EXPRESS CO	91,220	232.440	21,203,176.800	
AMERICAN ELECTRIC POWER	83,039	88.550	7,353,103.450	
AFLAC INC	84,730	88.400	7,490,132.000	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	76.020	8,221,563.000	
ANALOG DEVICES	77,993	235.370	18,357,212.410	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	107,814	70.790	7,632,153.060	
VALERO ENERGY CORP	52,332	154.590	8,090,003.880	
ANSYS INC	13,252	323.310	4,284,504.120	
APPLE INC	2,316,207	193.120	447,305,895.840	
APPLIED MATERIALS INC	131,768	228.160	30,064,186.880	
ALBEMARLE CORP	18,991	114.060	2,166,113.460	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	61.950	5,049,172.800	
AMEREN CORP	40,644	71.500	2,906,046.000	
AUTODESK INC	33,059	218.200	7,213,473.800	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	64,371	246.870	15,891,268.770	
AUTOZONE INC	2,716	2,780.950	7,553,060.200	
AVERY DENNISON CORP	13,185	224.740	2,963,196.900	
BALL CORP	51,188	68.400	3,501,259.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	206,795	410.810	84,953,453.950	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	116,387	60.740	7,069,346.380	
BAXTER INTERNATIONAL INC	80,219	32.890	2,638,402.910	
BECTON DICKINSON & CO	45,522	239.510	10,902,974.220	
AMETEK INC	36,304	173.000	6,280,592.000	
VERIZON COMM INC	658,056	40.410	26,592,042.960	
WR BERKLEY CORP	31,607	79.770	2,521,290.390	
BEST BUY CO INC	30,568	87.150	2,664,001.200	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	284.450	859,323.450	
YUM! BRANDS INC	44,894	137.810	6,186,842.140	
FIRSTENERGY CORP	83,697	38.930	3,258,324.210	
BOEING CO	92,640	190.120	17,612,716.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	232,468	77.420	17,997,672.560	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	85.590	1,474,972.470	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	26,064	160.540	4,184,314.560	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,443.830	4,924,904.130	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	328,703	42.570	13,992,886.710	
ONEOK INC	90,252	80.020	7,221,965.040	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	127.300	1,235,955.700	
UNITED RENTALS INC	10,788	645.100	6,959,338.800	
SEMPRA	98,372	75.080	7,385,769.760	
FEDEX CORP	36,746	253.720	9,323,195.120	
VERISIGN INC	14,698	180.130	2,647,550.740	
AMPHENOL CORP	93,691	133.840	12,539,603.440	
BROWN-FORMAN CORP	37,193	42.910	1,595,951.630	
QUANTA SERVICES INC	23,271	271.570	6,319,705.470	
CSX CORP	304,211	32.930	10,017,668.230	
COTERRA ENERGY INC	114,711	28.120	3,225,673.320	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	42.460	1,145,485.880	
CONSTELLATION BRANDS INC	26,080	251.680	6,563,814.400	
CARDINAL HEALTH INC	38,298	98.840	3,785,374.320	
CARLISLE COS INC	7,520	408.980	3,075,529.600	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	16.530	2,453,184.240	
CATERPILLAR INC	79,692	329.610	26,267,280.120	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	14,608	156.110	2,280,454.880	
JPMORGAN CHASE & CO	453,769	199.610	90,576,830.090	
CHURCH & DWIGHT CO INC	38,911	107.720	4,191,492.920	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	25,734	115.260	2,966,100.840	
CINTAS CORP	14,169	684.170	9,694,004.730	
CISCO SYSTEMS INC	636,404	45.850	29,179,123.400	
CLEVELAND-CLIFFS INC	83,513	15.650	1,306,978.450	
CLOROX COMPANY	21,219	131.720	2,794,966.680	
COCA-COLA CO/THE	647,345	63.590	41,164,668.550	
COPART INC	135,251	53.590	7,248,101.090	
COLGATE-PALMOLIVE CO	121,309	93.900	11,390,915.100	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	39,791	232.760	9,261,753.160	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	307.980	2,749,645.440	
NRG ENERGY, INC.	34,874	79.970	2,788,873.780	
COMCAST CORP-CL A	628,449	38.790	24,377,536.710	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	29.290	2,156,886.310	
CONSOLIDATED EDISON INC	55,106	92.320	5,087,385.920	
CMS ENERGY CORP	44,128	60.500	2,669,744.000	
COOPER COS INC	31,884	95.080	3,031,530.720	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	51.900	1,579,628.400	
CORNING INC	126,561	36.860	4,665,038.460	
HEICO CORP-CL A	11,614	177.720	2,064,040.080	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	221.230	2,088,853.660	
CUMMINS INC	22,263	273.170	6,081,583.710	

DR HORTON INC	45,784	142.220	6,511,400.480	
DANAHER CORP	111,446	264.670	29,496,412.820	
MOODY'S CORP	25,623	401.860	10,296,858.780	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	67.250	5,110,798.250	
TARGET CORP	73,884	148.520	10,973,251.680	
DEERE & CO	41,361	368.300	15,233,256.300	
MORGAN STANLEY	194,579	96.390	18,755,469.810	
REPUBLIC SERVICES INC	33,574	187.720	6,302,511.280	
COSTAR GROUP INC	66,181	76.430	5,058,213.830	
DECKERS OUTDOOR CORP	4,174	1,054.950	4,403,361.300	
THE WALT DISNEY CO	290,514	102.740	29,847,408.360	
DOLLAR TREE INC	31,756	110.190	3,499,193.640	
DOVER CORP	22,599	177.950	4,021,492.050	
OMNICOM GROUP	30,586	89.960	2,751,516.560	
DTE ENERGY CO	33,700	112.640	3,795,968.000	
DUKE ENERGY CORP	123,490	102.520	12,660,194.800	
DARDEN RESTAURANTS INC	20,213	147.680	2,985,055.840	
EBAY INC	84,227	53.150	4,476,665.050	
BANK OF AMERICA CORP	1,123,470	39.670	44,568,054.900	
CITIGROUP INC	302,172	61.430	18,562,425.960	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	103.200	1,732,728.000	
EATON CORP PLC	62,605	322.980	20,220,162.900	
CADENCE DESIGN SYS INC	42,742	296.180	12,659,325.560	
ECOLAB INC	39,987	238.770	9,547,695.990	
REVVITY INC	17,972	109.300	1,964,339.600	
ELECTRONIC ARTS INC	38,801	136.210	5,285,084.210	
SALESFORCE INC	153,609	241.840	37,148,800.560	
ERIE INDEMNITY CO	4,050	358.540	1,452,087.000	
EMERSON ELECTRIC CO	91,786	108.730	9,979,891.780	
ATMOS ENERGY CORP	24,532	115.480	2,832,955.360	
ENTERGY CORP	33,557	108.060	3,626,169.420	
EOG RESOURCES INC	90,394	121.590	10,991,006.460	
EQUIFAX INC	20,668	232.750	4,810,477.000	
EQT CORP	69,040	41.130	2,839,615.200	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	118.810	4,258,863.260	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	126.810	2,842,446.150	
EXXON MOBIL CORP	708,790	113.080	80,149,973.200	
NEXTERA ENERGY INC	321,345	76.970	24,733,924.650	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,019	406.240	2,445,158.560	
FAIR ISAAC CORP	3,775	1,310.150	4,945,816.250	
ASSURANT INC	8,766	172.580	1,512,836.280	
FASTENAL CO	89,185	63.380	5,652,545.300	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	35.620	3,754,704.200	
M&T BANK CORP	27,461	143.850	3,950,264.850	
FISERV INC	93,994	149.600	14,061,502.400	
FORD MOTOR CO	608,574	12.380	7,534,146.120	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	22.850	1,084,849.450	

FREEMPORT-MCMORAN INC	224,733	50.000	11,236,650.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,670.840	2,646,610.560	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	35,124	255.170	8,962,591.080	
GENERAL DYNAMICS CORP	35,855	294.680	10,565,751.400	
GENERAL MILLS INC	88,517	66.900	5,921,787.300	
GENUINE PARTS CO	23,115	142.470	3,293,194.050	
GILEAD SCIENCES INC	195,725	65.250	12,771,056.250	
GARTNER INC	11,988	436.300	5,230,364.400	
MCKESSON CORP	20,854	591.280	12,330,553.120	
NVIDIA CORP	3,947,550	121.790	480,772,114.500	
GRACO INC	27,006	79.420	2,144,816.520	
GENERAL ELECTRIC CO	172,827	162.840	28,143,148.680	
VW GRAINGER INC	7,145	897.360	6,411,637.200	
HALLIBURTON CO	139,251	34.510	4,805,552.010	
MONSTER BEVERAGE CORP	124,220	51.000	6,335,220.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	50,906	453.550	23,088,416.300	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	30,142	221.420	6,674,041.640	
HENRY SCHEIN INC	20,863	67.420	1,406,583.460	
HEICO CORP	6,878	224.710	1,545,555.380	
HERSHEY FOODS CORP	24,324	191.120	4,648,802.880	
HP INC	161,800	36.180	5,853,924.000	
F5 INC	8,981	167.310	1,502,611.110	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	82.670	1,498,393.750	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	275.250	2,096,028.750	
JUNIPER NETWORKS INC	50,704	35.430	1,796,442.720	
HOLOGIC INC	38,399	73.970	2,840,374.030	
HOME DEPOT INC	156,766	332.560	52,134,100.960	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29,668	82.940	2,460,663.920	
HORMEL FOODS CORP	49,054	30.580	1,500,071.320	
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	30.430	2,975,323.680	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	506.960	2,492,722.320	
HUBBELL INC	8,750	369.010	3,228,837.500	
HUMANA INC	19,692	349.340	6,879,203.280	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	162.010	1,988,834.760	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	240,636	12.580	3,027,200.880	
BIOGEN INC	23,241	225.980	5,252,001.180	
IDEX CORP	12,292	202.910	2,494,169.720	
ILLINOIS TOOL WORKS	46,463	239.370	11,121,848.310	
INTUIT INC	43,873	567.240	24,886,520.520	
IDEXX LABORATORIES INC	13,177	508.260	6,697,342.020	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	35,154	325.080	11,427,862.320	
INTEL CORP	675,827	30.910	20,889,812.570	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	96.770	3,966,892.610	

INTERNATIONAL PAPER CO	53,419	44.790	2,392,637.010	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	63,859	30.450	1,944,506.550	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	164.050	1,945,140.850	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	117.100	2,293,520.600	
INCYTE CORP	31,654	59.400	1,880,247.600	
EMCOR GROUP INC	7,710	379.030	2,922,321.300	
JOHNSON & JOHNSON	381,746	147.130	56,166,288.980	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	100.870	4,605,623.330	
KLA CORPORATION	21,525	794.380	17,099,029.500	
DEVON ENERGY CORP	104,410	47.120	4,919,799.200	
KELLANOVA	42,451	59.090	2,508,429.590	
KEYCORP	144,072	13.670	1,969,464.240	
KIMBERLY-CLARK CORP	52,932	135.470	7,170,698.040	
BLACKROCK INC/NEW YORK	23,262	766.170	17,822,646.540	
KROGER CO	109,187	51.640	5,638,416.680	
LAM RESEARCH CORP	20,608	1,003.070	20,671,266.560	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	7,446	389.080	2,897,089.680	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	184.410	2,480,498.910	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	61.450	1,244,977.000	
AKAMA I TECHNOLOGIES	23,313	90.340	2,106,096.420	
LENNAR CORP	39,936	155.420	6,206,853.120	
ELI LILLY & CO	127,635	865.000	110,404,275.000	
BATH & BODY WORKS INC	34,638	45.630	1,580,531.940	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	113,751	137.680	15,661,237.680	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,654	133.030	6,339,411.620	
LOCKHEED MARTIN CORP	34,947	467.460	16,336,324.620	
LOEWS CORP	30,289	75.340	2,281,973.260	
LOWE'S COS INC	90,060	218.100	19,642,086.000	
DOMINION ENERGY INC	133,247	51.460	6,856,890.620	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	40.770	1,647,148.770	
MCCORMICK & CO INC	40,279	68.110	2,743,402.690	
MCDONALD'S CORPORATION	113,473	253.810	28,800,582.130	
S&P GLOBAL INC	50,752	430.000	21,823,360.000	
EVEREST GROUP LTD	6,670	381.610	2,545,338.700	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,579.700	3,179,936.100	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	96,225	86.100	8,284,972.500	
MARSH & MCLENNAN COS	77,392	209.610	16,222,137.120	
MASCO CORP	34,561	67.140	2,320,425.540	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,993	552.340	5,519,533.620	

METLIFE INC	97,405	70.270	6,844,649.350	
MEDTRONIC PLC	211,853	83.140	17,613,458.420	
CVS HEALTH CORP	197,356	60.280	11,896,619.680	
MERCK & CO. INC.	400,277	131.490	52,632,422.730	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	73.500	4,795,875.000	
MICROSOFT CORP	1,114,523	427.870	476,870,956.010	
MICRON TECH INC	175,614	134.820	23,676,279.480	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	85,807	94.300	8,091,600.100	
3M CO	86,733	100.660	8,730,543.780	
ENTEGRIS INC	23,675	132.430	3,135,280.250	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	214.510	1,646,149.740	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	25,570	373.800	9,558,066.000	
ILLUMINA INC	24,379	109.820	2,677,301.780	
XCEL ENERGY INC	88,125	55.240	4,868,025.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	134.700	1,968,371.100	
NETAPP INC	32,785	122.905	4,029,440.420	
NEWMONT CORP	182,697	41.300	7,545,386.100	
NVR INC	483	7,544.200	3,643,848.600	
NIKE INC-CL B	191,229	96.000	18,357,984.000	
NORDSON CORP	8,735	225.280	1,967,820.800	
NORFOLK SOUTHERN CORP	35,167	225.110	7,916,443.370	
EVERSOURCE ENERGY	57,685	59.040	3,405,722.400	
NISOURCE INC	64,543	28.430	1,834,957.490	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	82.780	2,720,813.040	
NORTHROP GRUMMAN CORP	22,098	435.770	9,629,645.460	
WELLS FARGO & CO	559,960	57.930	32,438,482.800	
NUCOR CORP	37,496	157.310	5,898,495.760	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	157.970	5,753,583.340	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	59,829	140.900	8,429,906.100	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	104,338	60.480	6,310,362.240	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	31,348	171.120	5,364,269.760	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	975.140	8,858,171.760	
ORACLE CORP	260,850	124.500	32,475,825.000	
PACCAR INC	84,799	107.430	9,109,956.570	
PTC INC	18,085	175.540	3,174,640.900	
EXELON CORP	157,197	36.210	5,692,103.370	
PARKER HANNIFIN CORP	19,900	526.000	10,467,400.000	
PAYCHEX INC	51,491	121.940	6,278,812.540	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,452	255.700	2,928,276.400	
PPL CORPORATION	113,687	28.160	3,201,425.920	
PEPSICO INC	217,383	165.900	36,063,839.700	
PENTAIR PLC	25,545	78.600	2,007,837.000	
PFIZER INC	886,150	28.070	24,874,230.500	



ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	36.950	1,489,787.050	
CONOCOPHILLIPS	183,994	113.300	20,846,520.200	
PG&E CORP	322,749	18.440	5,951,491.560	
ALTRIA GROUP INC	271,033	46.490	12,600,324.170	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	61,632	152.690	9,410,590.080	
BROWN & BROWN INC	36,907	89.640	3,308,343.480	
GARMIN LTD	23,281	162.620	3,785,956.220	
PPG INDUSTRIES INC	37,839	128.460	4,860,797.940	
COSTCO WHOLESALE CORP	69,979	848.340	59,365,984.860	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	115.070	3,946,095.510	
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	141.470	2,344,723.780	
PROCTER & GAMBLE CO	371,648	167.350	62,195,292.800	
PROGRESSIVE CORP	91,760	210.280	19,295,292.800	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	78,981	73.440	5,800,364.640	
PULTE GROUP INC	33,950	113.400	3,849,930.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	40,068	97.330	3,899,818.440	
QUALCOMM INC	176,726	209.350	36,997,588.100	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	32,000	119.550	3,825,600.000	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	42.890	1,117,070.050	
RELIANCE INC	8,747	284.570	2,489,133.790	
REGENERON PHARMACEUTICALS	17,218	1,001.730	17,247,787.140	
REPLIGEN CORP	8,576	141.230	1,211,188.480	
RESMED INC	22,899	211.660	4,846,802.340	
US BANCORP	241,484	38.750	9,357,505.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	60,197	100.580	6,054,614.260	
ROSS STORES INC	53,462	144.760	7,739,159.120	
ROLLINS INC	45,708	46.790	2,138,677.320	
ROPER TECHNOLOGIES INC	17,283	556.500	9,617,989.500	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,355	255.230	4,684,746.650	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	37,464	155.400	5,821,905.600	
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	109.640	2,111,447.120	
ACCENTURE PLC-CL A	99,745	290.430	28,968,940.350	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	213,957	67.300	14,399,306.100	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	255.620	4,145,389.540	
AXON ENTERPRISE INC	11,039	285.400	3,150,530.600	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	37,112	213.000	7,904,856.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	93,547	77.290	7,230,247.630	
BOOKING HOLDINGS INC	5,452	3,788.720	20,656,101.440	
SCHLUMBERGER LTD	225,828	44.980	10,157,743.440	
SCHWAB (CHARLES) CORP	235,761	74.110	17,472,247.710	
POOL CORP	6,305	342.400	2,158,832.000	

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	112.880	3,625,028.320	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	64.940	940,136.380	
ELEVANCE HEALTH INC	36,775	536.250	19,720,593.750	
CENCORA INC	27,268	234.570	6,396,254.760	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	79.220	2,819,519.020	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	37,500	293.110	10,991,625.000	
CENTENE CORP	82,487	69.840	5,760,892.080	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	81.480	1,593,993.240	
SNAP-ON INC	8,204	267.900	2,197,851.600	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,528	117.370	6,752,061.360	
EDISON INTERNATIONAL	65,558	73.850	4,841,458.300	
SOUTHERN CO	171,064	78.970	13,508,924.080	
TRUIST FINANCIAL CORP	206,811	36.020	7,449,332.220	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	29.700	585,090.000	
AT&T INC	1,120,157	17.860	20,006,004.020	
CHEVRON CORP	279,196	156.740	43,761,181.040	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	82.020	1,852,995.840	
STATE STREET CORP	50,416	74.350	3,748,429.600	
STARBUCKS CORP	181,598	81.600	14,818,396.800	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	123.670	2,836,618.790	
STRYKER CORP	54,274	348.170	18,896,578.580	
NETFLIX INC	68,404	644.500	44,086,378.000	
GEN DIGITAL INC	92,583	24.480	2,266,431.840	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	49.690	1,361,506.000	
SYNOPSIS INC	23,883	576.180	13,760,906.940	
SYSCO CORP	81,369	72.250	5,878,910.250	
INTUITIVE SURGICAL INC	56,196	418.380	23,511,282.480	
TELEFLEX INC	6,985	207.090	1,446,523.650	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	16.850	2,851,862.500	
TERADYNE INC	24,830	143.080	3,552,676.400	
TEXAS INSTRUMENTS INC	144,838	197.620	28,622,885.560	
TEXTRON INC	29,841	86.340	2,576,471.940	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	60,368	581.480	35,102,784.640	
TORO CO	14,644	96.510	1,413,292.440	
DAVITA INC	9,106	141.580	1,289,227.480	
TRACTOR SUPPLY CO	16,808	273.620	4,599,004.960	
BIO-TECHNE CORP	25,934	77.100	1,999,511.400	
TRIMBLE INC	37,504	55.360	2,076,221.440	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,817	477.020	3,251,845.340	
TYSON FOODS INC	47,194	55.950	2,640,504.300	
MARATHON OIL CORP	92,952	28.280	2,628,682.560	
UNION PACIFIC CORP	95,466	228.950	21,856,940.700	

RTX CORP	210,899	107.090	22,585,173.910	
UNITEDHEALTH GROUP INC	145,896	495.000	72,218,520.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	188.930	1,870,973.790	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	11.980	974,285.480	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	40,371	483.280	19,510,496.880	
VULCAN MATERIALS CO	21,478	247.810	5,322,463.180	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	15.940	1,707,556.560	
WALMART INC	699,507	66.960	46,838,988.720	
WASTE MANAGEMENT INC	62,122	201.710	12,530,628.620	
WATERS CORP	9,943	301.470	2,997,516.210	
WATSCO INC	5,565	463.160	2,577,485.400	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,464	319.860	3,666,875.040	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	113.600	1,772,614.400	
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	77.100	3,812,672.100	
WABTEC CORP	28,400	163.740	4,650,216.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,319	93.520	2,367,832.880	
WYNN RESORTS LTD	15,379	92.870	1,428,247.730	
NASDAQ INC	66,854	59.300	3,964,442.200	
CME GROUP INC	55,935	198.500	11,103,097.500	
WILLIAMS COS INC	188,794	41.460	7,827,399.240	
WILLIAMS-SONOMA INC	9,646	296.940	2,864,283.240	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	216.220	1,848,897.220	
LKQ CORP	43,882	42.020	1,843,921.640	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	50.150	2,032,278.600	
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	79.440	3,803,746.080	
MICROSTRATEGY INC-CL A	2,539	1,599.920	4,062,196.880	
CARMAX INC	22,414	68.470	1,534,686.580	
TJX COMPANIES INC	180,029	107.320	19,320,712.280	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	302.600	2,355,741.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.310	516,522.190	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	37.520	882,770.560	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	153.470	2,957,520.370	
CBRE GROUP INC	48,577	87.620	4,256,316.740	
REGIONS FINANCIAL CORP	152,588	18.190	2,775,575.720	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	526.550	2,704,887.350	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,519	779.580	5,861,662.020	
CRH PLC	109,430	79.420	8,690,930.600	
WESTLAKE CORP	6,030	150.290	906,248.700	
T-MOBILE US INC	84,336	180.690	15,238,671.840	
LAS VEGAS SANDS CORP	59,474	44.730	2,660,272.020	

MOSAIC CO/THE	48,502	28.760	1,394,917.520	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	197.080	1,207,312.080	
CELANESE CORP	16,273	144.940	2,358,608.620	
DEXCOM INC	61,139	116.570	7,126,973.230	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	146.950	2,873,460.300	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	123.380	2,711,645.640	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	78.670	2,436,331.230	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	428.470	6,656,709.920	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	89,493	133.880	11,981,322.840	
LIVE NATION	23,597	89.750	2,117,830.750	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,367	3,129.880	13,668,185.960	
TRANSDIGM GROUP INC	8,828	1,305.990	11,529,279.720	
MASTERCARD INC	131,390	449.250	59,026,957.500	
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	66.170	1,563,133.910	
OWENS CORNING	13,227	176.400	2,333,242.800	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,679	144.720	2,992,664.880	
AERCAP HOLDINGS NV	30,064	92.100	2,768,894.400	
FIRST SOLAR INC	15,579	279.800	4,359,004.200	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	18,398	196.850	3,621,646.300	
SUPER MICRO COMPUTER INC	8,410	786.860	6,617,492.600	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	85.760	1,809,021.440	
DELTA AIR LINES INC	21,592	50.500	1,090,396.000	
INSULET CORP	10,158	192.040	1,950,742.320	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	125.810	4,930,242.280	
TE CONNECTIVITY LTD	48,949	149.670	7,326,196.830	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,837	318.260	5,676,803.620	
MERCADOLIBRE INC	7,171	1,601.880	11,487,081.480	
ULTA BEAUTY INC	7,263	382.500	2,778,097.500	
MSCI INC	12,591	484.010	6,094,169.910	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	243,027	103.680	25,197,039.360	
VISA INC	249,433	275.040	68,604,052.320	
KEURIG DR PEPPER INC	173,573	34.160	5,929,253.680	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	31,751	128.560	4,081,908.560	
MARATHON PETROLEUM CORP	57,711	174.340	10,061,335.740	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	66.220	1,419,094.600	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	314,617	19.800	6,229,416.600	
XYLEM INC	36,891	139.250	5,137,071.750	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	40,421	95.560	3,862,630.760	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	247.940	1,606,899.140	

EPAM SYSTEMS INC	9,031	176.980	1,598,306.380	
HCA HEALTHCARE INC	30,702	341.260	10,477,364.520	
VERISK ANALYTICS INC	23,047	263.480	6,072,423.560	
CORPAY INC	11,338	259.190	2,938,696.220	
NXP SEMICONDUCTOR NV	40,642	276.850	11,251,737.700	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	21,225	151.840	3,222,804.000	
TARGA RESOURCES CORP	33,263	119.910	3,988,566.330	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	18,053	171.570	3,097,353.210	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	61.720	2,116,687.400	
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	127.690	4,270,464.360	
FORTINET INC	100,599	60.090	6,044,993.910	
HYATT HOTELS CORP	6,647	146.060	970,860.820	
TESLA INC	453,473	173.790	78,809,072.670	
ENPHASE ENERGY INC	21,539	130.670	2,814,501.130	
GENERAL MOTORS CO	184,183	47.570	8,761,585.310	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	38.560	1,512,708.800	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	280.860	3,340,829.700	
APTIV PLC	43,097	79.660	3,433,107.020	
PHILLIPS 66	68,358	138.120	9,441,606.960	
META PLATFORMS INC	346,441	502.600	174,121,246.600	
IQVIA HOLDINGS INC	29,794	215.830	6,430,439.020	
DIAMONDBACK ENERGY INC	26,616	193.970	5,162,705.520	
SERVICENOW INC	32,168	709.150	22,811,937.200	
PALO ALTO NETWORKS INC	51,424	309.050	15,892,587.200	
WORKDAY INC	34,175	212.730	7,270,047.750	
ABBVIE INC	280,584	170.460	47,828,348.640	
ZOETIS INC	72,227	178.830	12,916,354.410	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	27.210	1,475,081.310	
CDW CORP	22,078	223.900	4,943,264.200	
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	83.650	5,279,151.500	
TWILIO INC	25,710	57.800	1,486,038.000	
SNAP INC	152,250	15.190	2,312,677.500	
TRADE DESK INC A	69,828	92.650	6,469,564.200	
OKTA INC	25,106	89.110	2,237,195.660	
BAKER HUGHES CO	152,160	32.440	4,936,070.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	85.490	1,862,399.650	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	10.110	1,637,435.820	
BROADCOM INC	69,434	1,440.470	100,017,593.980	
ARES MANAGEMENT CORP	30,178	136.840	4,129,557.520	
MONGODB INC	10,906	224.620	2,449,705.720	
BURLINGTON STORES INC	10,565	230.950	2,439,986.750	
VEEVA SYSTEMS INC	23,273	184.990	4,305,272.270	
EVERGY INC	41,706	53.050	2,212,503.300	
ALLEGION PLC	13,423	117.490	1,577,068.270	
DAYFORCE INC	22,002	50.680	1,115,061.360	
STERIS PLC	15,540	224.790	3,493,236.600	

DOCUSIGN INC	31,974	50.990	1,630,354.260	
WIX.COM LTD	8,997	168.830	1,518,963.510	
KKR & CO INC	99,156	108.950	10,803,046.200	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	9,649	74.880	722,517.120	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	39,400	62.960	2,480,624.000	
MODERNA INC	50,006	148.590	7,430,391.540	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	204.820	8,240,318.240	
CIGNA GROUP	45,163	338.650	15,294,449.950	
DELL TECHNOLOGIES INC	41,930	132.450	5,553,628.500	
DOW INC	113,128	56.050	6,340,824.400	
OVINTIV INC	39,160	48.520	1,900,043.200	
AMCOR PLC	223,348	9.910	2,213,378.680	
PINTEREST INC	90,936	44.040	4,004,821.440	
FOX CORP-A	36,501	33.690	1,229,718.690	
FOX CORP-B	27,507	31.400	863,719.800	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	36,603	374.570	13,710,385.710	
AVANTOR INC	107,376	23.470	2,520,114.720	
DYNATRACE INC	39,362	46.530	1,831,513.860	
CLOUDFLARE INC	46,487	71.720	3,334,047.640	
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	104.750	1,772,160.500	
CARRIER GLOBAL CORP	129,836	62.540	8,119,943.440	
OTIS WORLDWIDE CORP	62,600	97.750	6,119,150.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	297,430	68.600	20,403,698.000	
CORTEVA INC	108,001	51.710	5,584,731.710	
MATCH GROUP INC	44,764	31.850	1,425,733.400	
FERGUSON PLC	32,186	200.070	6,439,453.020	
BLACKSTONE INC	112,027	119.700	13,409,631.900	
PAYLOCITY HOLDING CORP	7,385	139.540	1,030,502.900	
CARLYLE GROUP INC	34,847	40.700	1,418,272.900	
DATADOG INC	42,674	112.990	4,821,735.260	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	99.520	3,074,172.800	
VERTIV HOLDINGS CO	57,675	91.300	5,265,727.500	
INGERSOLL RAND INC	61,976	91.190	5,651,591.440	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	70,281	75.780	5,325,894.180	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	146.300	1,308,068.300	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	131,052	11.870	1,555,587.240	
DRAFTKINGS INC	63,900	38.050	2,431,395.000	
CHORD ENERGY CORP	10,665	173.290	1,848,137.850	
UNITY SOFTWARE INC	40,967	17.970	736,176.990	
AON PLC	31,309	286.860	8,981,299.740	
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	8.120	2,853,538.520	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,718	723.280	1,965,875.040	
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	48.950	1,646,384.300	
COINBASE GLOBAL INC	29,730	249.810	7,426,851.300	

UIPATH INC	77,540	12.010	931,255.400	
AIRBNB INC	70,377	148.070	10,420,722.390	
CONSTELLATION ENERGY CORP	50,134	214.630	10,760,260.420	
MONDAY.COM LTD	6,356	225.210	1,431,434.760	
SOLVENTUM CORP	21,683	56.710	1,229,642.930	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39,050	29.290	1,143,774.500	
APPROVIN CORP	29,028	80.380	2,333,270.640	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	27.390	1,702,918.470	
ROBLOX CORP	78,921	34.990	2,761,445.790	
VIATRIS INC	184,148	10.510	1,935,395.480	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	36.380	1,258,893.520	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	88.940	1,409,343.240	
HF SINCLAIR CORP	25,560	53.430	1,365,670.800	
SNOWFLAKE INC	48,671	126.760	6,169,535.960	
DOORDASH INC	45,626	112.250	5,121,518.500	
ARISTA NETWORKS INC	42,313	297.580	12,591,502.540	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	61,704	118.770	7,328,584.080	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	31.480	500,311.640	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	290,013	23.130	6,708,000.690	
FNF GROUP	38,907	48.960	1,904,886.720	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	140.020	2,621,594.460	
MARVELL TECHNOLOGY INC	134,511	69.470	9,344,479.170	
APA CORP	66,483	29.470	1,959,254.010	
CONFLUENT INC	27,524	26.070	717,550.680	
LINDE PLC	75,685	432.000	32,695,920.000	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	23.420	1,722,915.720	
U-HAUL HOLDING CO	16,864	60.730	1,024,150.720	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	201.990	751,604.790	
TOAST INC	56,667	22.560	1,278,407.520	
GE VERNOVA INC	44,235	166.640	7,371,320.400	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.640	1,017,434.600	
CATALENT INC	27,357	56.190	1,537,189.830	
SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	44.340	3,046,202.340	
VERALTO CORP	37,086	99.850	3,703,037.100	
SAMSARA INC	27,908	30.950	863,752.600	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	32,552	72.210	2,350,579.920	
BUNGE GLOBAL SA	21,715	105.750	2,296,361.250	
KENVUE INC	319,052	18.290	5,835,461.080	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	34.380	2,510,186.940	
CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	252.460	1,716,475.540	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	136.740	3,789,475.620	
HUBSPOT INC	7,360	595.920	4,385,971.200	

	QORVO INC	14,144	102.360	1,447,779.840	
	LABCORP HOLDINGS INC	12,876	195.920	2,522,665.920	
	GODADDY INC	22,534	142.040	3,200,729.360	
	ETSY INC	18,558	66.070	1,226,127.060	
	TRANSUNION	31,262	72.290	2,259,929.980	
	ALBERTSONS COS INC	54,086	20.040	1,083,883.440	
	BLOCK INC	90,085	64.340	5,796,068.900	
	DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	79.880	5,450,611.800	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	74.310	2,304,501.720	
	WESTROCK CO	42,166	50.500	2,129,383.000	
	KRAFT HEINZ CO	149,302	33.550	5,009,082.100	
	FORTIVE CORP	55,370	73.150	4,050,315.500	
	WASTE CONNECTIONS INC	41,029	167.790	6,884,255.910	
	ALPHABET INC-CL A	933,019	175.010	163,287,655.190	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	206,262	20.590	4,246,934.580	
	PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	67.090	10,634,234.630	
	SEA LTD ADR	58,070	72.970	4,237,367.900	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	40.640	2,289,210.560	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	43.500	973,269.000	
	ALPHABET INC-CL C	803,690	176.630	141,955,764.700	
	PURE STORAGE INC	50,378	66.100	3,329,985.800	
	ZSCALER INC	14,051	183.910	2,584,119.410	
	ATLISSIAN CORP PLC	23,713	162.170	3,845,537.210	
	ROKU INC	19,331	57.880	1,118,878.280	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,049	276.070	4,154,577.430	
	VISTRA CORP	53,965	88.220	4,760,792.300	
アメリカ・ドル	小計	57,037,025		7,263,857,275.350 (1,142,822,665,131)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	21.590	1,323,359.050	
	ASHTAD GROUP	66,851	56.420	3,771,733.420	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	24.060	1,095,884.880	
	BARCLAYS PLC	2,403,221	2.147	5,159,715.480	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	180,896	5.018	907,736.120	
	BT GROUP PLC	1,150,803	1.296	1,491,440.680	
	BUNZL PLC	53,979	29.480	1,591,300.920	
	AVIVA PLC	429,205	4.700	2,017,263.500	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	42.320	870,649.360	
	DIAGEO PLC	346,858	26.070	9,042,588.060	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.814	420,935.920	
	DCC PLC	17,471	56.200	981,870.200	
	NATIONAL GRID PLC	776,127	8.724	6,770,931.940	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.588	869,635.280	
	BAE SYSTEMS PLC	481,015	14.000	6,734,210.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	315,055	24.020	7,567,621.100	



HALMA PLC	62,208	22.840	1,420,830.720	
NEXT PLC	18,588	92.080	1,711,583.040	
IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	19.800	2,498,344.200	
ANGLO AMERICAN PLC	193,117	23.730	4,582,666.410	
COMPASS GROUP PLC	273,244	22.070	6,030,495.080	
HSBC HOLDINGS PLC	2,973,100	6.936	20,621,421.600	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	949,467	2.460	2,335,688.820	
CENTRICA PLC	793,776	1.338	1,062,072.280	
UNILEVER PLC	392,026	43.690	17,127,615.940	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,134	10.105	1,163,429.070	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	25.460	1,401,394.780	
PEARSON PLC	84,159	9.540	802,876.860	
PERSIMMON PLC	56,989	14.460	824,060.940	
PRUDENTIAL PLC	418,146	7.208	3,013,996.360	
RIO TINTO PLC	180,086	53.570	9,647,207.020	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.708	2,536,695.320	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	110,858	44.200	4,899,923.600	
RELX PLC	289,143	35.030	10,128,679.290	
RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.093	1,534,240.580	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,303,232	4.650	6,060,028.800	
NATWEST GROUP PLC	1,067,086	3.109	3,317,570.370	
SSE PLC	168,922	17.895	3,022,859.190	
BP PLC	2,686,693	4.708	12,648,950.640	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	10.440	1,588,926.240	
SMITHS GROUP PLC	51,695	17.150	886,569.250	
SPIRAX GROUP PLC	10,751	86.950	934,799.450	
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	7.532	2,730,560.890	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,868,076	0.542	5,348,497.190	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.496	852,515.040	
TESCO PLC	1,122,991	3.058	3,434,106.470	
3I GROUP PLC	149,486	29.470	4,405,352.420	
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	10.270	1,293,301.100	
GSK PLC	644,763	16.210	10,451,608.230	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	72,616	94.000	6,825,904.000	
WPP PLC	176,061	7.680	1,352,148.480	
ASTRAZENECA PLC	245,561	126.000	30,940,686.000	
WHITBREAD PLC	31,475	29.970	943,305.750	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	48.460	1,129,554.140	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	10.195	532,474.650	
INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	79.820	2,145,082.680	
SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.632	699,604.020	
ADMIRAL GROUP PLC	40,084	26.570	1,065,031.880	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	51.850	854,954.650	

	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	19.300	356,181.500	
	EXPERIAN PLC	149,242	36.500	5,447,333.000	
	MONDI PLC	67,554	14.900	1,006,554.600	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,623	10.740	704,791.020	
	INFORMA PLC	223,961	8.364	1,873,209.800	
	GLENCORE PLC	1,638,764	4.758	7,797,239.110	
	ENTAIN PLC	96,924	7.038	682,151.110	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	27.000	837,945.000	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	4.890	664,198.920	
	M&G PLC	270,401	2.030	548,914.030	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	16.490	462,956.750	
	WISE PLC	96,207	8.330	801,404.310	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.244	475,296.320	
	HALEON PLC	1,088,551	3.233	3,519,285.380	
	SHELL PLC	1,015,561	27.575	28,004,094.570	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	8.236	1,179,296.360	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	27,104	147.900	4,008,681.600	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	6.194	1,338,672.050	
	イギリス・ポンド 小計	42,773,685		307,132,694.780 (61,509,464,784)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	187,404	33.140	6,210,568.560	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	30.170	7,213,134.110	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	688.100	2,291,373.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.580	3,027,499.520	
	ICL GROUP LTD	103,067	17.130	1,765,537.710	
	NICE LTD	10,202	661.000	6,743,522.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	130.100	3,830,664.400	
	AZRIELI GROUP	4,672	225.000	1,051,200.000	
	イスラエル・シュケル 小計	740,146		32,133,499.300 (1,349,912,239)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	49.300	1,395,485.800	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	540,278	26.970	14,571,297.660	
	FORTESCUE LTD	272,505	24.370	6,640,946.850	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.560	2,135,476.680	
	ASX LTD	31,215	64.320	2,007,748.800	
	BHP GROUP LTD	794,747	44.530	35,390,083.910	
	AMPOL LTD	31,828	34.460	1,096,792.880	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	27.150	2,487,591.600	
	CSL LIMITED	76,024	289.000	21,970,936.000	
	REA GROUP LTD	9,317	188.410	1,755,415.970	
	TRANSURBAN GROUP	476,258	12.800	6,096,102.400	
	COCHLEAR LTD	10,446	332.070	3,468,803.220	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	10.350	2,667,112.200	

COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	262,177	125.550	32,916,322.350	
RIO TINTO LIMITED	56,991	125.310	7,141,542.210	
APA GROUP	222,829	8.580	1,911,872.820	
ARISTOCRAT LEISU	86,829	47.180	4,096,592.220	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	6.560	2,362,137.920	
PRO MEDICUS LTD	11,011	125.870	1,385,954.570	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	69,336	46.440	3,219,963.840	
ORICA LTD	63,862	18.270	1,166,758.740	
BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	21.140	1,619,049.180	
MACQUARIE GROUP LTD	56,701	196.270	11,128,705.270	
SUNCORP GROUP LTD	199,628	16.530	3,299,850.840	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	482,840	35.230	17,010,453.200	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.200	698,485.800	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	259,760	18.580	4,826,340.800	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	191,685	14.560	2,790,933.600	
REECE LTD	31,558	25.980	819,876.840	
SANTOS LTD	478,809	7.550	3,615,007.950	
SONIC HEALTHCARE	64,897	24.980	1,621,127.060	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	32.000	1,261,440.000	
WESFARMERS LTD	183,319	67.140	12,308,037.660	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	296,262	27.210	8,061,289.020	
WOOLWORTHS GROUP LTD	210,430	32.440	6,826,349.200	
SEEK LTD	58,513	23.190	1,356,916.470	
MINERAL RESOURCES LTD	28,865	68.630	1,981,004.950	
BRAMBLES LTD	220,767	14.650	3,234,236.550	
PILBARA MINERALS LTD	404,496	3.650	1,476,410.400	
CAR GROUP LTD	58,310	36.630	2,135,895.300	
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	28,600	40.170	1,148,862.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.770	840,140.730	
TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	12.070	1,628,363.700	
XERO LTD	23,149	129.290	2,992,934.210	
LOTTERY CORP LTD	366,780	5.170	1,896,252.600	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.120	1,196,236.800	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	491,554	29.180	14,343,545.720	
MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.790	1,564,326.290	
SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.870	2,642,196.060	
COLES GROUP LTD	197,589	16.980	3,355,061.220	
WISETECH GLOBAL LTD	27,325	100.080	2,734,686.000	
オーストラリア・ドル 小計	10,630,601		276,298,954.060	

(28,707,461,327)

カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	80,569	89.780	7,233,484.820	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	22.630	6,053,411.850	
	BANK OF MONTREAL	113,881	116.240	13,237,527.440	
	BANK OF NOVA SCOTIA	189,801	63.870	12,122,589.870	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	117.670	6,084,245.020	
	BCE INC	14,197	46.640	662,148.080	
	BROOKFIELD CORP	218,478	57.330	12,525,343.740	
	SAPUTO INC	34,582	29.510	1,020,514.820	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	15,252	126.940	1,936,088.880	
	CGI INC	31,091	139.770	4,345,589.070	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	71.890	1,513,859.620	
	CAE INC	55,407	24.910	1,380,188.370	
	CAMECO CORP	66,084	73.770	4,875,016.680	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	52.540	2,804,322.500	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	153,504	67.110	10,301,653.440	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	171,312	97.610	16,721,764.320	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	138.980	1,238,450.780	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	31.170	509,006.100	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	87,929	171.110	15,045,531.190	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	52.500	1,582,455.000	
	OPEN TEXT CORP	40,459	38.880	1,573,045.920	
	EMPIRE CO LTD	20,608	32.730	674,499.840	
	KINROSS GOLD CORP	192,737	10.370	1,998,682.690	
	RB GLOBAL INC	26,641	108.900	2,901,204.900	
	FORTIS INC	82,632	54.880	4,534,844.160	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	117,480	17.070	2,005,383.600	
	TELUS CORP	31,890	22.180	707,320.200	
	GREAT WEST LIFECO INC	43,551	40.490	1,763,379.990	
	IMPERIAL OIL LTD	27,434	90.490	2,482,502.660	
	ENBRIDGE INC	339,116	49.080	16,643,813.280	
	IGM FINANCIAL INC	12,478	37.430	467,051.540	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	283,749	36.110	10,246,176.390	
	LOBLAW CO LTD	24,803	159.690	3,960,791.070	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	120,276	77.940	9,374,311.440	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	60.070	2,539,699.530	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	90,324	68.070	6,148,354.680	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,425	1,550.530	5,310,565.250	
	METRO INC	35,059	74.370	2,607,337.830	
	EMERA INC	44,643	47.470	2,119,203.210	
	ONEX CORP	10,157	97.310	988,377.670	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	27.590	1,527,741.070	
	POWER CORP OF CANADA	89,864	40.150	3,608,039.600	

QUEBECOR INC-B	30,598	29.030	888,259.940	
ROYAL BANK OF CANADA	224,529	146.210	32,828,385.090	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	144,017	105.630	15,212,515.710	
STANTEC INC	18,358	111.440	2,045,815.520	
SUNCOR ENERGY INC	198,439	52.510	10,420,031.890	
LUNDIN MINING CORP	119,660	15.410	1,843,960.600	
TECK RESOURCES LTD-CL B	72,863	68.100	4,961,970.300	
THOMSON REUTERS CORP	24,837	234.990	5,836,446.630	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	119.990	1,571,509.030	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	275,206	75.950	20,901,895.700	
TC ENERGY CORP	164,747	53.730	8,851,856.310	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	108.610	879,958.220	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	194.800	1,916,637.200	
INTACT FINANCIAL CORP	28,756	230.050	6,615,317.800	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	73,865	74.040	5,468,964.600	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,192	3,869.980	12,352,976.160	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	165.180	4,859,595.600	
TOURMALINE OIL CORP	49,085	67.460	3,311,274.100	
KEYERA CORP	39,997	36.780	1,471,089.660	
PARKLAND CORP	24,129	39.570	954,784.530	
ALTAGAS LTD	47,249	30.900	1,459,994.100	
PEMBINA PIPELINE CORP	94,699	51.300	4,858,058.700	
DOLLARAMA INC	45,462	126.750	5,762,308.500	
MEG ENERGY CORP	47,181	28.680	1,353,151.080	
CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	26.690	6,052,411.230	
ARC RESOURCES LTD	96,301	25.270	2,433,526.270	
NORTHLAND POWER INC	34,152	24.390	832,967.280	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	25.140	1,288,249.020	
TMX GROUP LTD	46,884	37.230	1,745,491.320	
BRP INC	4,307	84.210	362,692.470	
IVANHOE MINES LTD	98,820	18.340	1,812,358.800	
NUTRIEN LTD	77,339	75.850	5,866,163.150	
TFI INTERNATIONAL INC	11,591	197.410	2,288,179.310	
WSP GLOBAL INC	20,394	207.420	4,230,123.480	
IA FINANCIAL CORP INC	16,448	87.990	1,447,259.520	
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	51.050	1,820,800.350	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	43.450	1,257,529.900	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	52.250	2,730,010.250	
AIR CANADA	41,858	17.600	736,700.800	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	93.100	4,200,020.300	

	SHOPIFY INC	190,088	86.820	16,503,440.160	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	207.300	1,085,630.100	
	HYDRO ONE LTD	56,437	40.650	2,294,164.050	
カナダ・ドル	小計	6,343,246		420,989,992.840 (48,119,156,182)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	4.080	1,182,384.000	
	SEBMCORP INDUSTRIES	162,200	5.010	812,622.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	310,981	35.630	11,080,253.030	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.600	1,343,040.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.880	669,849.840	
	KEPPEL LTD	249,600	6.580	1,642,368.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	561,898	14.230	7,995,808.540	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	2.540	3,405,708.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.790	1,656,760.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	30.730	5,886,823.180	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.100	801,350.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.600	1,053,754.000	
シンガポール・ドル	小計	4,915,758		37,530,720.790 (4,363,696,906)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	90.760	2,154,097.840	
	NESTLE SA-REGISTERED	422,890	95.600	40,428,284.000	
	CIE FINANC RICHEMONT	83,477	148.550	12,400,508.350	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	112,161	239.700	26,884,991.700	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	233.600	1,240,649.600	
	SIKA INHABER	24,746	270.200	6,686,369.200	
	SGS SA-REG	22,978	83.140	1,910,390.920	
	NOVARTIS AG-REG SHS	311,901	94.300	29,412,264.300	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,117	155.000	1,258,135.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	711	1,548.000	1,100,628.000	
	CLARIANT AG-REG	45,795	13.950	638,840.250	
	SWISSCOM AG-REG	4,457	502.000	2,237,414.000	
	ABB LTD	254,623	50.360	12,822,814.280	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	32.800	867,691.200	
	GEBERIT AG	5,105	551.800	2,816,939.000	
	LONZA GROUP AG-REG	11,536	501.000	5,779,536.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	161	10,600.000	1,706,600.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	108,000.000	1,728,000.000	
	GIVAUDAN-REG	1,459	4,362.000	6,364,158.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,758	476.400	10,841,911.200	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	265.400	1,276,574.000	
	HOLCIM LTD	81,467	80.460	6,554,834.820	
	TEMENOS GROUP	10,930	60.400	660,172.000	

	BACHEM HOLDING AG	4,673	78.450	366,596.850	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	287.100	2,325,510.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,597	267.300	2,297,978.100	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,475	115.550	1,903,686.250	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	187.800	807,540.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	36.850	341,194.150	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	120.200	589,701.200	
	SCHINDLER NAMEN	4,209	229.000	963,861.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	631.600	2,844,094.800	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	95.700	469,217.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	731.000	910,095.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,356	83.850	1,119,900.600	
	AVOLTA AG	12,933	35.940	464,812.020	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,160.000	3,982,280.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	51.280	1,646,805.920	
	SWISS RE LTD	49,210	112.250	5,523,822.500	
	BKW AG	3,194	143.300	457,700.200	
	SIG GROUP AG	50,969	17.360	884,821.840	
	ALCON INC	78,777	81.780	6,442,383.060	
	SANDOZ GROUP AG	65,523	31.630	2,072,492.490	
	UBS GROUP AG	515,558	28.030	14,451,090.740	
	VAT GROUP AG	4,131	490.800	2,027,494.800	
スイス・フラン	小計	2,385,965		230,664,882.280 (40,449,393,757)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	422,695	203.700	86,102,971.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	175.400	42,423,822.600	
	ERICSSON LM-B SHS	465,668	65.120	30,324,300.160	
	GETINGE AB-B SHS	38,925	183.250	7,133,006.250	
	LUNDBERGS B	14,872	529.000	7,867,288.000	
	SKF AB-B SHS	46,594	226.000	10,530,244.000	
	SANDVIK AB	169,218	221.700	37,515,630.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	250,203	151.100	37,805,673.300	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	182.200	8,005,321.400	
	SWEDBANK AB	132,581	215.600	28,584,463.600	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	92,795	156.050	14,480,659.750	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	98.660	21,591,346.360	
	TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	419.200	15,574,956.800	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	278.800	6,746,402.400	
	VOLVO AB-B SHS	263,434	272.400	71,759,421.600	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	427.400	7,402,568.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	103.550	7,005,571.700	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	363.600	5,560,171.200	
	INDUSTRIVARDEN C	31,300	361.600	11,318,080.000	
	SAAB AB-B	47,156	263.400	12,420,890.400	

	SECURITAS AB-B SHS	76,085	108.250	8,236,201.250	
	INVESTOR AB-B SHS	271,548	286.850	77,893,543.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	184.450	19,306,197.050	
	ASSA ABLOY AB-B	153,368	308.800	47,360,038.400	
	TELIA CO AB	344,810	27.110	9,347,799.100	
	BOLIDEN AB	49,208	352.500	17,345,820.000	
	ALFA LAVAL AB	44,407	480.100	21,319,800.700	
	FASTIGHETS AB BALDER	117,966	68.660	8,099,545.560	
	INDUTRADE AB	39,178	271.400	10,632,909.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	86.460	4,130,107.740	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	49.760	10,590,520.320	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	273.200	9,939,289.200	
	HEXAGON AB-B SHS	333,533	116.850	38,973,331.050	
	SAGAX AB	28,022	271.800	7,616,379.600	
	EPIROC AB-A	103,115	216.000	22,272,840.000	
	EPIROC AB-B	61,487	196.400	12,076,046.800	
	ESSITY AB-B	99,980	279.000	27,894,420.000	
	EQT AB	55,194	312.600	17,253,644.400	
	VOLVO CAR AB	143,747	36.500	5,246,765.500	
	BEIJER REF AB	50,493	165.400	8,351,542.200	
	LIFCO AB	39,631	280.600	11,120,458.600	
	EVOLUTION AB	28,266	1,114.000	31,488,324.000	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	295.700	8,172,556.600	
スウェーデン・クローナ 小計		5,111,038		904,820,870.690 (13,572,313,060)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	957.600	14,523,919.200	
	A P MOLLER A/S	663	12,300.000	8,154,900.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	11,970.000	6,499,710.000	
	DANSKE BANK A/S	102,303	209.300	21,412,017.900	
	GENMAB A/S	11,480	1,922.500	22,070,300.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	59,656	419.900	25,049,554.400	
	ROCKWOOL AS	1,677	2,844.000	4,769,388.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	515,587	988.400	509,606,190.800	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	184.850	28,563,206.850	
	COLOPLAST-B	21,291	833.600	17,748,177.600	
	DSV A/S	28,190	1,116.500	31,474,135.000	
	DEMANT A/S	17,700	326.200	5,773,740.000	
	TRYG A/S	58,222	144.000	8,383,968.000	
	PANDORA A/S	12,473	1,116.000	13,919,868.000	
ORSTED A/S	26,911	393.800	10,597,551.800		
デンマーク・クローネ 小計		1,026,384		728,546,627.550 (16,538,008,445)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229,726	7.580	1,741,323.080	
	FISHER & PAYKEL	95,209	29.550	2,813,425.950	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	4.090	1,279,037.070	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.565	412,505.210	



	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	6.430	1,538,750.440	
ニュージーランド・ドル 小計		939,800		7,785,041.750 (750,555,875)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	184.250	13,471,991.500	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	68.640	15,181,932.480	
	TELENOR ASA	119,576	124.800	14,923,084.800	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	923.000	10,323,755.000	
	ORKLA ASA	116,068	86.700	10,063,095.600	
	EQUINOR ASA	141,333	299.150	42,279,766.950	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	315.800	9,288,941.200	
	AKER BP ASA	40,933	259.400	10,618,020.200	
	SALMAR ASA	12,897	593.000	7,647,921.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	184.000	4,732,664.000	
DNB BANK ASA	143,909	202.200	29,098,399.800		
ノルウェー・クローネ 小計		935,336		167,629,572.530 (2,477,565,082)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	25,025	76.950	1,925,673.750	
	KINGSPAN GROUP PLC	24,704	85.500	2,112,192.000	
	UMICORE	33,545	16.670	559,195.150	
	AIR LIQUIDE	91,877	168.120	15,446,361.240	
	AIRBUS SE	92,897	149.460	13,884,385.620	
	AXA SA	279,056	32.330	9,021,880.480	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	107,926	30.400	3,280,950.400	
	ADIDAS AG	25,992	229.700	5,970,362.400	
	ASSICURAZIONI GENERALI	159,200	23.630	3,761,896.000	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	192.900	601,848.000	
	DANONE	101,632	59.340	6,030,842.880	
	SAFRAN SA	52,883	208.300	11,015,528.900	
	INTESA SANPAOLO	2,332,761	3.568	8,323,291.240	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,783	91.300	4,545,187.900	
	ACCOR SA	31,427	38.830	1,220,310.410	
	BOUYGUES	29,123	33.380	972,125.740	
	BNP PARIBAS	160,893	63.210	10,170,046.530	
	THALES SA	15,023	169.600	2,547,900.800	
	CAPGEMINI SA	25,063	193.050	4,838,412.150	
	LOTUS BAKERIES NV	77	9,840.000	757,680.000	
	UNICREDIT SPA	235,573	36.255	8,540,699.110	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	149.000	1,848,047.000	
	D'IETEREN TRDG	2,736	203.400	556,502.400	
	COMMERZBANK AG	158,792	15.345	2,436,663.240	
	EIFFAGE	12,706	94.140	1,196,142.840	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	68,521	30.160	2,066,593.360	
PUBLICIS GROUPE	36,027	102.650	3,698,171.550		
IBERDROLA SA	939,014	12.165	11,423,105.310		
ENI SPA	332,847	14.108	4,695,805.470		

JERONIMO MARTINS	45,606	19.890	907,103.340	
KESKO OYJ-B	35,252	16.400	578,132.800	
KBC GROUPE	40,769	66.120	2,695,646.280	
HANNOVER RUECK SE	9,638	232.800	2,243,726.400	
WARTSILA OYJ	77,148	19.340	1,492,042.320	
L'OREAL	37,684	452.550	17,053,894.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	43,840	746.300	32,717,792.000	
GEA GROUP AG	25,513	37.860	965,922.180	
BOLLORE	114,808	5.920	679,663.360	
MEDIOBANCA SPA	86,792	14.180	1,230,710.560	
MICHELIN(CGDE)-B	109,281	38.060	4,159,234.860	
CONTINENTAL AG	17,635	61.000	1,075,735.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	161,929	39.210	6,349,236.090	
OMV AG	23,354	41.760	975,263.040	
VERBUND AG	10,663	75.300	802,923.900	
PERNOD-RICARD	33,037	135.250	4,468,254.250	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	49.570	1,155,526.270	
RENAULT SA	27,902	51.640	1,440,859.280	
REPSOL SA	195,049	14.700	2,867,220.300	
REMY COINTREAU	2,866	81.750	234,295.500	
MERCK KGAA	20,216	171.900	3,475,130.400	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	74,653	77.120	5,757,239.360	
RWE AG	98,751	33.610	3,319,021.110	
SEB SA	2,596	109.100	283,223.600	
SOCIETE GENERALE-A	116,635	24.080	2,808,570.800	
VINCI S.A.	78,711	104.800	8,248,912.800	
SODEXO	12,910	86.550	1,117,360.500	
SOFINA	2,281	218.000	497,258.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	85,324	228.050	19,458,138.200	
VIVENDI SE	98,944	9.836	973,213.180	
SAP SE	165,383	176.820	29,243,022.060	
TELEFONICA S.A	755,720	4.337	3,277,557.640	
TOTALENERGIES SE	338,784	65.210	22,092,104.640	
E.ON SE	339,366	12.315	4,179,292.290	
VOEST-ALPINE AG	18,032	26.160	471,717.120	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	74.550	1,333,401.300	
SIEMENS AG-REG	118,974	174.440	20,753,824.560	
UPM-KYMMENE OYJ	86,201	34.040	2,934,282.040	
ING GROEP NV-CVA	510,410	16.228	8,282,933.480	
PUMA AG	17,210	46.950	808,009.500	
BAYER AG	157,617	27.475	4,330,527.070	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	12.725	1,221,345.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	84.920	2,054,299.720	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	123,737	65.520	8,107,248.240	
BASF SE	143,233	46.150	6,610,202.950	

BEIERSDORF AG	15,743	144.150	2,269,353.450	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	95.680	2,065,348.480	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	39.350	1,323,419.200	
ASM INTERNATIONAL NV	7,273	691.600	5,030,006.800	
ORANGE	286,957	9.938	2,851,778.660	
SAMPO OYJ-A SHS	70,999	39.880	2,831,440.120	
RANDSTAD NV	15,584	47.020	732,759.680	
ALLIANZ SE	61,413	259.400	15,930,532.200	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	3.726	1,883,273.160	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	28.170	4,131,609.390	
HERMES INTL	5,084	2,139.000	10,874,676.000	
ENDESA S.A.	50,946	18.545	944,793.570	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	6.230	676,870.810	
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	44.630	2,524,897.620	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	21,873	460.500	10,072,516.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	23.290	1,889,494.410	
DASSAULT SYSTEMES SA	111,221	36.770	4,089,596.170	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	40.620	1,415,038.320	
RHEINMETALL STAMM	6,662	531.400	3,540,186.800	
HEINEKEN NV	43,759	94.760	4,146,602.840	
AKZO NOBEL	26,032	61.340	1,596,802.880	
ASML HOLDING NV	62,985	963.400	60,679,749.000	
AEGON LTD	232,433	5.908	1,373,214.160	
VOLKSWAGEN AG	5,460	123.000	671,580.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	112.350	3,418,248.750	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	914,652	9.760	8,927,003.520	
KERING	11,443	327.950	3,752,731.850	
ACCIONA S.A.	5,005	118.300	592,091.500	
FORTUM OYJ	73,699	13.990	1,031,049.010	
AGEAS	24,086	43.720	1,053,039.920	
UCB SA	20,020	130.050	2,603,601.000	
NEMETSCHKE SE	10,222	94.100	961,890.200	
CARREFOUR SA	90,642	14.590	1,322,466.780	
NOKIA OYJ	827,068	3.599	2,976,617.730	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	125,932	24.450	3,079,037.400	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	148.500	5,750,514.000	
SANOFI	178,244	90.270	16,090,085.880	
STMICROELECTRONICS NV	104,058	41.240	4,291,351.920	
ELISA OYJ	20,242	43.440	879,312.480	
BANCO SANTANDER SA	2,548,588	4.711	12,006,398.060	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	16.900	1,108,454.100	
QIAGEN N.V.	34,544	41.475	1,432,712.400	
DEUTSCHE BANK AG-REG	308,007	15.280	4,706,346.960	

BMW VORZUG	7,821	86.450	676,125.450	
ENEL SPA	1,241,600	6.679	8,292,646.400	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	501,748	22.610	11,344,522.280	
SARTORIUS AG	3,651	248.500	907,273.500	
LEONARDO SPA	64,915	24.400	1,583,926.000	
CTS EVENTIM AG	11,578	79.450	919,872.100	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	206,726	37.715	7,796,671.090	
RATIONAL AG	860	808.000	694,880.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	7,150	85.950	614,542.500	
BECHTLE AG	14,521	46.960	681,906.160	
KONINKLIJKE KPN NV	693,784	3.501	2,428,937.780	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	54.120	1,246,816.560	
TELEPERFORMANCE	9,581	102.550	982,531.550	
DEUTSCHE BOERSE AG	31,372	186.100	5,838,329.200	
EURAZEO	5,673	75.950	430,864.350	
BANCO SABADELL	905,307	1.900	1,720,083.300	
GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	69.350	895,863.300	
HEINEKEN HOLDING NV-A	23,687	76.650	1,815,608.550	
INDITEX	168,449	45.710	7,699,803.790	
ESSILORLUXOTTICA	47,029	207.800	9,772,626.200	
SNAM SPA	317,518	4.409	1,399,936.860	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	14.115	2,356,089.910	
TENARIS SA	76,002	15.030	1,142,310.060	
TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.230	453,218.680	
TERNA SPA	207,655	7.762	1,611,818.110	
BIOMERIEUX	4,870	91.950	447,796.500	
GRIFOLS SA	31,982	9.118	291,611.870	
NESTE OYJ	66,248	18.555	1,229,231.640	
RECORDATI SPA	18,197	49.540	901,479.380	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	9.722	816,064.680	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	233.400	2,028,712.800	
KONE OYJ	54,590	47.020	2,566,821.800	
ELIA GROUP	4,078	93.100	379,661.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,801	185.450	890,345.450	
ENGIE	277,054	14.520	4,022,824.080	
ALSTOM	47,494	17.685	839,931.390	
IPSEN SA	5,964	122.800	732,379.200	
ARKEMA SA	10,489	89.100	934,569.900	
LEGRAND SA	41,105	97.760	4,018,424.800	
AMPLIFON SPA	20,249	33.630	680,973.870	
ADP	6,104	122.700	748,960.800	
ORION OYJ	13,559	38.340	519,852.060	
METSO CORPORATION	102,831	10.945	1,125,485.290	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	19.040	1,515,298.400	
SYMRISE AG	19,547	110.100	2,152,124.700	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	42.880	1,709,582.720	

REXEL SA	33,916	26.640	903,522.240	
PRYSMIAN SPA	44,284	57.880	2,563,157.920	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	99.860	242,559.940	
CAIXABANK	569,844	5.270	3,003,077.880	
BUREAU VERITAS SA	54,064	28.060	1,517,035.840	
GETLINK	63,968	16.145	1,032,763.360	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	14.240	565,157.120	
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	67.400	4,640,355.200	
BRENTAG SE	21,559	65.080	1,403,059.720	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	18.510	792,894.360	
EDENRED	42,160	43.400	1,829,744.000	
TALANX AG	10,349	74.550	771,517.950	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	76.960	916,978.400	
VONOVIA SE	120,411	26.640	3,207,749.040	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	10.100	1,657,975.600	
KNORR-BREMSE AG	10,342	72.450	749,277.900	
OCI NV	12,329	24.500	302,060.500	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	54.800	2,463,917.600	
FERRARI NV	19,594	384.200	7,528,014.800	
ASR NEDERLAND NV	27,365	45.400	1,242,371.000	
AIB GROUP PLC	226,914	5.100	1,157,261.400	
NORDEA BANK ABP	492,403	11.255	5,541,995.760	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	32.860	568,247.980	
MONCLER SPA	33,422	60.320	2,016,015.040	
NEXI SPA	83,576	6.028	503,796.120	
PROSUS NV	231,019	34.060	7,868,507.140	
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	73.600	1,352,105.600	
JDE PEET'S BV	14,385	19.950	286,980.750	
EXOR NV	14,142	100.000	1,414,200.000	
SIEMENS ENERGY AG	100,301	23.500	2,357,073.500	
INPOST SA	36,721	16.690	612,873.490	
EURONEXT NV	14,077	92.850	1,307,049.450	
IMCD NV	9,332	141.400	1,319,544.800	
NN GROUP NV	43,478	42.380	1,842,597.640	
FINCOBANK SPA	96,393	14.735	1,420,350.850	
ARGENX SE	9,078	350.600	3,182,746.800	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	125,611	28.250	3,548,510.750	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	83,468	38.070	3,177,626.760	
DSM-FIRMENICH AG	28,846	98.280	2,834,984.880	
SYENQO SA	11,217	92.370	1,036,114.290	
ZALANDO SE	31,321	23.280	729,152.880	
STELLANTIS NV	341,919	20.255	6,925,569.340	
FERROVIAL SE	84,753	36.060	3,056,193.180	
AENA SME SA	11,603	181.100	2,101,303.300	
CELLNEX TELECOM SAU	74,060	33.580	2,486,934.800	
BANCO BPM SPA	202,727	6.438	1,305,156.420	
ABN AMRO BANK NV	75,982	15.845	1,203,934.790	

	SCOUT24 SE	10,048	71.500	718,432.000	
	COVESTRO AG	27,558	48.500	1,336,563.000	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	143,260	57.260	8,203,067.600	
	POSTE ITALIANE SPA	88,762	12.755	1,132,159.310	
	AMUNDI SA	11,288	64.600	729,204.800	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	89,823	9.850	884,756.550	
	ADYEN NV	3,378	1,224.800	4,137,374.400	
	DELIVERY HERO SE	34,547	28.450	982,862.150	
ユーロ 小計		29,497,937		827,181,088.240 (140,066,573,672)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	241,796	65.600	15,861,817.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	45.600	4,255,118.400	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	192,391	270.800	52,099,482.800	
	MTR CORP	207,441	25.900	5,372,721.900	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	108.200	13,210,787.200	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	22.750	6,778,863.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	44.050	9,374,721.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	23.050	4,656,100.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.910	9,080,159.460	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	40.000	13,476,160.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	24.950	16,978,350.250	
	SINO LAND CO	659,200	8.480	5,590,016.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	73.600	15,055,984.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	68.350	3,623,917.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	97.050	20,880,889.800	
	AIA GROUP LTD	1,778,516	58.350	103,776,408.600	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	8.770	6,990,882.720	
	SANDS CHINA LTD	335,800	18.580	6,239,164.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	21.550	3,017,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	13.980	2,818,368.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	22.100	5,660,583.500		
WH GROUP LTD	1,001,000	5.320	5,325,320.000		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	427,945	38.650	16,540,074.250		
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	30.450	8,105,637.750		
香港・ドル 小計		10,459,903		354,768,527.230 (7,145,038,138)	
合計		172,796,824		1,507,871,804.598 (1,507,871,804,598)	

## (2) 株式以外の有価証券

2024年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル	小計	2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券 合計			2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,141,363.440	
		GOODMAN GROUP	271,455.000	9,585,076.050	
		GPT GROUP	349,447.000	1,499,127.630	
		MIRVAC GROUP	700,332.000	1,397,162.340	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,649,707.340	
		STOCKLAND	369,843.000	1,697,579.370	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,058,551.300	
	オーストラリア・ドル	小計	3,226,165.000	19,028,567.470 (1,977,068,160)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,550,845.070	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,576,581.240	
シンガポール・ドル	小計	1,398,309.000	3,127,426.310 (363,625,857)		
投資信託受益証券 合計			4,624,474	2,340,694,017 (2,340,694,017)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,823.000	3,055,676.160	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,821,031.450	
		AMERICAN TOWER CORP	73,276.000	14,268,302.720	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,576,185.450	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,518.000	4,289,398.120	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,445,864.840	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,811,988.030	
		CROWN CASTLE INC	67,799.000	6,769,730.150	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	47,689.000	7,109,953.010	
		EQUINIX INC	14,804.000	11,288,494.120	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,683,793.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,573,569.200	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,664,877.410	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	5,119,822.200	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	41,252.000	1,792,811.920	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	117,820.000	2,265,678.600	
HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	1,999,615.650			

	INVITATION HOMES INC	96,467.000	3,406,249.770	
	IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	3,798,953.600	
	KIMCO REALTY	111,968.000	2,075,886.720	
	MID AMERICA	17,537.000	2,428,874.500	
	PROLOGIS INC	148,197.000	16,475,060.490	
	PUBLIC STORAGE	24,573.000	6,733,493.460	
	REALTY INCOME CORP	142,408.000	7,506,325.680	
	REGENCY CENTERS CORP	27,176.000	1,651,213.760	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	3,194,673.240	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	51,092.000	7,768,027.680	
	SUN COMMUNITIES INC	21,946.000	2,506,891.580	
	UDR INC	50,449.000	2,009,383.670	
	VENTAS INC	60,757.000	3,031,774.300	
	VICI PROPERTIES INC	164,307.000	4,618,669.770	
	WELLTOWER INC	91,071.000	9,428,580.630	
	WEYERHAEUSER CO	114,764.000	3,370,618.680	
	WP CAREY INC	32,996.000	1,848,765.880	
	アメリカ・ドル 小計	2,035,258.000	154,390,235.440 (24,290,215,742)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	782,675.250	
	SEGRO PLC	207,676.000	1,880,713.850	
	イギリス・ポンド 小計	329,021.000	2,663,389.100 (533,396,935)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	384,378.540	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	245,208.000	
	カナダ・ドル 小計	23,146.000	629,586.540 (71,961,742)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	244,079.880	
	GECINA SA	8,697.000	863,612.100	
	KLEPIERRE	36,407.000	974,251.320	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,477.000	1,450,814.040	
	WAREHOUSES DE PAUW	31,043.000	812,084.880	
	ユーロ 小計	99,690.000	4,344,842.220 (735,712,133)	
香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	13,902,932.400	
	香港・ドル 小計	410,116.000	13,902,932.400 (280,005,059)	
	投資証券 合計	2,897,231	25,911,291,611 (25,911,291,611)	
	合計		28,251,985,628 (28,251,985,628)	

(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	580銘柄 72.88	-	-	-	75.98
	投資証券	34銘柄 -	-	-	1.55	
イギリス・ポンド	株式	77銘柄 3.92	-	-	-	4.04
	投資証券	2銘柄 -	-	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式	8銘柄 0.09	-	-	-	0.09
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄 1.83	-	-	-	2.00
	投資信託受益証 券	7銘柄 -	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式	85銘柄 3.07	-	-	-	3.14
	新株予約権証券	1銘柄 -	0.00	-	-	
	投資証券	2銘柄 -	-	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式	12銘柄 0.28	-	-	-	0.31
	投資信託受益証 券	2銘柄 -	-	0.02	-	
スイス・フラン	株式	45銘柄 2.58	-	-	-	2.63
スウェーデン・クロー ナ	株式	43銘柄 0.87	-	-	-	0.88
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄 1.05	-	-	-	1.08
ニュージーランド・ド ル	株式	5銘柄 0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄 0.16	-	-	-	0.16
ユーロ	株式	218銘柄 8.93	-	-	-	9.17
	投資証券	5銘柄 -	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	24銘柄 0.46	-	-	-	0.48
	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	83,240,463,997
コール・ローン	396,195,542
国債証券	239,460,888,938
派生商品評価勘定	523,108,298
未収入金	53,264,187
未収利息	509,296,543
前払費用	705,665,956
流動資産合計	324,888,883,461
資産合計	324,888,883,461
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	746,074,946
未払金	82,096,020,853
未払解約金	12,415,000
流動負債合計	82,854,510,799
負債合計	82,854,510,799
純資産の部	
元本等	
元本	211,589,183,489
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	30,445,189,173
元本等合計	242,034,372,662
純資産合計	242,034,372,662
負債純資産合計	324,888,883,461

## 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12月12日 至 2024年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	218,509,951,433円
同期中追加設定元本額	290,923,907,242円
同期中一部解約元本額	297,844,675,186円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	13,662,203,321円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,611,095,079円
たわらノーロード バランス(標準型)	5,002,140,301円
たわらノーロード バランス(積極型)	2,734,953,427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)	48,718,231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)	1,629,913,186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)	1,716,129,723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)	190,652,688円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	2,565,255円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	16,646,363円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	167,862,581円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	8,411,437円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	91,804円
投資のソムリエ	64,059,067,492円
投資のソムリエ<DC年金>	6,807,913,472円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	13,525,217,575円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	41,429,806,015円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,791,410,235円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	4,962,853,657円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	522,306,583円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	270,867,911円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	125,647,393円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,493,969,850円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	15,409,752,966円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,800,462,879円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	529,466,162円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	289,759,212円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	178,589,569円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	45,127,139円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	10,672,198円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	18,117,626,696円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	5,253,632,513円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,024,053,434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)	37,056,830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)	355,875,560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)	31,002,748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)	281,971,124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)	598,031,612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)	845,485,875円
計	211,589,183,489円
2. 受益権の総数	211,589,183,489口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年6月11日現在
----	--------------

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		1,606,749,452
合計		1,606,749,452

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年6月23日から2024年6月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年6月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	240,459,669,043	-	240,682,635,691	222,966,648	
アメリカ・ドル	112,991,253,142	-	113,581,880,730	590,627,588	
イギリス・ポンド	12,606,281,211	-	12,645,955,570	39,674,359	
イスラエル・シケル	757,132,368	-	755,395,156	1,737,212	
オーストラリア・ドル	3,097,253,325	-	3,088,940,568	8,312,757	
オフショア・人民元	23,991,723,854	-	24,083,678,863	91,955,009	
カナダ・ドル	4,868,325,254	-	4,851,930,840	16,394,414	
シンガポール・ドル	1,008,800,270	-	1,011,380,480	2,580,210	
スウェーデン・クローナ	393,884,362	-	395,061,045	1,176,683	
デンマーク・クローネ	624,925,090	-	621,952,512	2,972,578	
ニュージーランド・ドル	596,224,327	-	595,741,259	483,068	
ノルウェー・クローネ	396,829,426	-	393,981,696	2,847,730	
ポーランド・ズロチ	1,338,311,797	-	1,317,986,177	20,325,620	
マレーシア・リンギット	1,130,816,355	-	1,129,956,000	860,355	
メキシコ・ペソ	2,095,410,247	-	1,971,424,231	123,986,016	

ユーロ	74,562,498,015	-	74,237,370,564	325,127,451
合計	240,459,669,043	-	240,682,635,691	222,966,648

## (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)

	2024年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1439円 (11,439円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2024年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/31/25	1,500,000.000	1,430,106.600	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,500,000.000	1,420,224.610	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,500,000.000	1,414,511.710	
		US T N/B 0.25 09/30/25	1,300,000.000	1,221,619.130	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,872,265.620	
		US T N/B 0.375 01/31/26	1,000,000.000	928,203.120	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,100,000.000	2,717,828.120	
		US T N/B 0.375 09/30/27	2,820,000.000	2,457,475.770	
		US T N/B 0.375 12/31/25	1,080,000.000	1,006,003.130	
		US T N/B 0.5 02/28/26	3,900,000.000	3,616,488.290	
		US T N/B 0.5 04/30/27	3,400,000.000	3,020,820.300	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,600,000.000	2,302,625.000	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,500,000.000	2,208,007.800	
		US T N/B 0.5 08/31/27	2,900,000.000	2,545,203.120	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,617,089.840	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,000,000.000	2,683,476.570	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,190,000.000	4,159,095.710			

US T N/B 0.625 07/31/26	4,180,000.000	3,827,230.860	
US T N/B 0.625 08/15/30	6,090,000.000	4,837,267.990	
US T N/B 0.625 11/30/27	4,300,000.000	3,756,789.080	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,360,000.000	2,926,874.990	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,070,000.000	3,552,505.840	
US T N/B 0.75 03/31/26	6,530,000.000	6,064,482.430	
US T N/B 0.75 04/30/26	4,862,000.000	4,502,287.940	
US T N/B 0.75 05/31/26	4,890,000.000	4,514,749.810	
US T N/B 0.75 08/31/26	3,680,000.000	3,368,278.120	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,716,000.000	4,354,747.040	
US T N/B 0.875 09/30/26	3,310,000.000	3,031,753.120	
US T N/B 0.875 11/15/30	5,990,000.000	4,802,412.290	
US T N/B 1.0 07/31/28	4,470,000.000	3,878,685.330	
US T N/B 1.125 02/15/31	5,500,000.000	4,459,511.690	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,000,742.180	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,720,000.000	3,285,079.690	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,000,000.000	1,830,117.170	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,260,000.000	1,969,243.750	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,770,000.000	3,280,857.230	
US T N/B 1.125 10/31/26	3,270,000.000	3,003,546.070	
US T N/B 1.25 03/31/28	3,500,000.000	3,098,046.860	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,000,000.000	3,532,343.760	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,100,000.000	2,013,644.510	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,640,000.000	4,088,637.520	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,070,000.000	2,698,362.100	
US T N/B 1.25 08/15/31	6,000,000.000	4,826,835.950	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,250,000.000	3,709,370.120	
US T N/B 1.25 11/30/26	5,150,000.000	4,734,077.130	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,830,000.000	3,513,800.600	
US T N/B 1.375 08/15/50	3,500,000.000	1,773,515.620	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,750,000.000	1,624,150.390	
US T N/B 1.375 10/31/28	3,600,000.000	3,153,164.070	
US T N/B 1.375 11/15/31	6,000,000.000	4,836,796.850	
US T N/B 1.375 11/15/40	3,930,000.000	2,463,925.760	
US T N/B 1.375 12/31/28	3,300,000.000	2,878,283.190	
US T N/B 1.5 01/31/27	4,900,000.000	4,512,115.210	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,000,000.000	3,407,968.750	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,475,602.350	
US T N/B 1.5 11/30/28	4,340,000.000	3,814,876.960	
US T N/B 1.625 02/15/26	2,300,000.000	2,177,183.580	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,422,000.000	5,099,327.450	
US T N/B 1.625 05/15/31	5,850,000.000	4,870,696.310	
US T N/B 1.625 08/15/29	2,800,000.000	2,436,656.260	
US T N/B 1.625 09/30/26	4,000,000.000	3,727,812.480	
US T N/B 1.625 10/31/26	1,330,000.000	1,236,484.370	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,300,000.000	2,331,070.320	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,600,000.000	1,484,687.500	
US T N/B 1.75 01/31/29	3,600,000.000	3,188,390.610	
US T N/B 1.75 08/15/41	3,700,000.000	2,429,064.450	

US T N/B 1.75 11/15/29	2,000,000.000	1,743,203.120	
US T N/B 1.75 12/31/26	900,000.000	836,191.400	
US T N/B 1.875 02/15/32	6,480,000.000	5,395,992.160	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,400,000.000	2,989,335.910	
US T N/B 1.875 02/15/51	5,450,000.000	3,152,697.250	
US T N/B 1.875 02/28/27	4,000,000.000	3,713,593.760	
US T N/B 1.875 02/28/29	2,700,000.000	2,401,312.500	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,000,000.000	1,885,312.500	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,881,210.940	
US T N/B 1.875 11/15/51	4,400,000.000	2,529,828.130	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,500,000.000	2,108,339.830	
US T N/B 2.0 08/15/25	1,800,000.000	1,736,507.800	
US T N/B 2.0 08/15/51	3,800,000.000	2,260,554.670	
US T N/B 2.0 11/15/26	3,900,000.000	3,655,183.580	
US T N/B 2.0 11/15/41	3,200,000.000	2,182,437.500	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,200,000.000	2,087,164.060	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,900,000.000	3,660,972.660	
US T N/B 2.25 02/15/52	3,070,000.000	1,937,877.540	
US T N/B 2.25 03/31/26	6,000,000.000	5,725,781.280	
US T N/B 2.25 05/15/41	2,600,000.000	1,869,562.500	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,600,000.000	2,418,000.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,100,000.000	1,390,429.690	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,790,000.000	1,790,122.830	
US T N/B 2.25 11/15/25	1,500,000.000	1,442,695.320	
US T N/B 2.25 11/15/27	2,440,000.000	2,258,953.890	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,100,000.000	2,241,445.320	
US T N/B 2.375 03/31/29	1,700,000.000	1,545,273.440	
US T N/B 2.375 04/30/26	6,800,000.000	6,493,203.100	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,000,000.000	2,813,320.320	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,820,000.000	2,558,323.820	
US T N/B 2.375 05/15/51	3,580,000.000	2,337,628.120	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,880,000.000	1,897,649.990	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,110,000.000	1,494,226.160	
US T N/B 2.5 02/15/46	2,000,000.000	1,400,156.240	
US T N/B 2.5 02/28/26	1,000,000.000	959,863.280	
US T N/B 2.5 03/31/27	3,900,000.000	3,679,253.910	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,800,000.000	1,256,695.300	
US T N/B 2.625 01/31/26	780,000.000	751,176.560	
US T N/B 2.625 02/15/29	3,000,000.000	2,763,222.660	
US T N/B 2.625 05/31/27	3,800,000.000	3,585,953.140	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,100,000.000	2,837,347.660	
US T N/B 2.625 12/31/25	1,400,000.000	1,350,507.810	
US T N/B 2.75 02/15/28	3,900,000.000	3,659,525.370	
US T N/B 2.75 04/30/27	4,000,000.000	3,793,671.880	
US T N/B 2.75 05/31/29	2,900,000.000	2,676,609.370	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,500,000.000	1,463,512.020	
US T N/B 2.75 07/31/27	2,650,000.000	2,504,508.790	
US T N/B 2.75 08/15/32	7,580,000.000	6,692,607.040	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,480,000.000	1,129,482.800	



US T N/B 2.75 08/15/47	2,700,000.000	1,955,285.150	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,000,000.000	972,128.910	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,500,000.000	1,140,703.120	
US T N/B 2.75 11/15/47	1,700,000.000	1,228,416.020	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,150,000.000	2,927,162.100	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,440,000.000	3,233,331.260	
US T N/B 2.875 05/15/32	7,400,000.000	6,615,339.810	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,590,000.000	1,225,604.290	
US T N/B 2.875 05/15/49	2,500,000.000	1,834,472.650	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,300,000.000	3,127,158.180	
US T N/B 2.875 05/31/25	800,000.000	782,474.240	
US T N/B 2.875 06/15/25	2,000,000.000	1,954,939.360	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,270,000.000	1,238,870.110	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,400,000.000	5,059,546.840	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,500,000.000	1,131,005.860	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,650,000.000	1,231,119.130	
US T N/B 2.875 11/30/25	1,140,000.000	1,105,577.340	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,590,000.000	1,211,070.700	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,200,000.000	1,663,750.000	
US T N/B 3.0 02/15/49	2,300,000.000	1,731,558.580	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,500,000.000	1,194,433.590	
US T N/B 3.0 05/15/45	800,000.000	617,687.490	
US T N/B 3.0 05/15/47	2,000,000.000	1,520,585.940	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,210,000.000	1,666,823.430	
US T N/B 3.0 08/15/52	2,600,000.000	1,939,335.940	
US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,947,734.380	
US T N/B 3.0 10/31/25	500,000.000	486,289.060	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,500,000.000	1,162,822.260	
US T N/B 3.0 11/15/45	1,000,000.000	769,433.590	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,000,000.000	814,531.250	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,260,000.000	1,013,118.750	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,520,000.000	1,947,979.670	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,000,000.000	1,586,757.820	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,000,000.000	2,865,468.750	
US T N/B 3.125 08/31/29	2,700,000.000	2,530,037.100	
US T N/B 3.125 11/15/28	3,710,000.000	3,503,196.460	
US T N/B 3.125 11/15/41	580,000.000	474,127.340	
US T N/B 3.25 05/15/42	2,650,000.000	2,188,372.060	
US T N/B 3.25 06/30/27	2,890,000.000	2,776,149.800	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,000,000.000	2,831,835.930	
US T N/B 3.375 05/15/33	7,100,000.000	6,529,642.580	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,000,000.000	2,480,976.570	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,800,000.000	2,348,062.500	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,350,000.000	1,897,716.780	
US T N/B 3.5 01/31/28	2,900,000.000	2,795,214.840	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,500,000.000	2,377,929.690	
US T N/B 3.5 02/15/33	5,400,000.000	5,023,792.960	
US T N/B 3.5 02/15/39	300,000.000	267,890.620	
US T N/B 3.5 04/30/28	2,800,000.000	2,695,000.000	

US T N/B 3.5 04/30/30	2,200,000.000	2,089,355.460	
US T N/B 3.5 09/15/25	2,500,000.000	2,450,976.550	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,000,000.000	860,429.690	
US T N/B 3.625 02/15/53	2,850,000.000	2,403,685.550	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,000,000.000	2,902,265.640	
US T N/B 3.625 03/31/30	1,800,000.000	1,721,812.500	
US T N/B 3.625 05/15/26	2,800,000.000	2,735,414.050	
US T N/B 3.625 05/15/53	2,880,000.000	2,429,156.240	
US T N/B 3.625 05/31/28	2,150,000.000	2,078,193.350	
US T N/B 3.625 08/15/43	800,000.000	690,125.000	
US T N/B 3.75 04/15/26	3,650,000.000	3,575,217.770	
US T N/B 3.75 05/31/30	2,700,000.000	2,597,378.910	
US T N/B 3.75 06/30/30	2,500,000.000	2,403,857.420	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,500,000.000	1,344,199.210	
US T N/B 3.75 11/15/43	2,000,000.000	1,755,000.000	
US T N/B 3.75 12/31/28	3,700,000.000	3,584,591.770	
US T N/B 3.75 12/31/30	2,390,000.000	2,292,486.130	
US T N/B 3.875 01/15/26	1,600,000.000	1,572,531.240	
US T N/B 3.875 02/15/43	2,200,000.000	1,974,328.130	
US T N/B 3.875 05/15/43	2,200,000.000	1,971,062.500	
US T N/B 3.875 08/15/33	5,400,000.000	5,156,789.070	
US T N/B 3.875 08/15/40	700,000.000	643,343.750	
US T N/B 3.875 09/30/29	3,000,000.000	2,912,871.090	
US T N/B 3.875 11/30/27	2,900,000.000	2,832,654.280	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,600,000.000	2,523,015.610	
US T N/B 3.875 12/31/27	2,800,000.000	2,734,703.130	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,500,000.000	2,425,000.000	
US T N/B 4.0 01/15/27	4,630,000.000	4,547,708.970	
US T N/B 4.0 01/31/29	4,600,000.000	4,503,417.980	
US T N/B 4.0 01/31/31	2,000,000.000	1,945,859.380	
US T N/B 4.0 02/15/26	2,400,000.000	2,362,546.860	
US T N/B 4.0 02/15/34	6,400,000.000	6,164,499.960	
US T N/B 4.0 02/28/30	2,200,000.000	2,146,375.000	
US T N/B 4.0 02/29/28	2,200,000.000	2,156,687.500	
US T N/B 4.0 06/30/28	2,800,000.000	2,743,835.940	
US T N/B 4.0 07/31/30	1,500,000.000	1,461,708.990	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,900,000.000	2,832,484.370	
US T N/B 4.0 11/15/42	2,000,000.000	1,830,195.320	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,170,000.000	3,768,718.930	
US T N/B 4.0 12/15/25	1,900,000.000	1,872,056.640	
US T N/B 4.125 02/15/27	4,190,000.000	4,127,804.680	
US T N/B 4.125 03/31/29	4,500,000.000	4,427,929.710	
US T N/B 4.125 03/31/31	2,500,000.000	2,449,804.700	
US T N/B 4.125 06/15/26	2,500,000.000	2,464,843.750	
US T N/B 4.125 07/31/28	3,300,000.000	3,248,373.050	
US T N/B 4.125 08/15/53	3,950,000.000	3,647,500.970	
US T N/B 4.125 08/31/30	2,500,000.000	2,451,904.300	
US T N/B 4.125 09/30/27	2,380,000.000	2,344,160.550	
US T N/B 4.125 10/31/27	1,500,000.000	1,477,001.950	

US T N/B 4.125 11/15/32	7,700,000.000	7,514,117.220	
US T N/B 4.25 01/31/26	3,700,000.000	3,657,074.220	
US T N/B 4.25 02/15/54	4,900,000.000	4,627,437.500	
US T N/B 4.25 02/28/29	3,700,000.000	3,661,988.270	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,400,000.000	2,369,250.000	
US T N/B 4.25 03/15/27	5,000,000.000	4,942,773.450	
US T N/B 4.25 05/15/39	900,000.000	873,035.150	
US T N/B 4.25 05/31/25	1,500,000.000	1,486,241.440	
US T N/B 4.25 10/15/25	570,000.000	563,865.810	
US T N/B 4.25 11/15/40	300,000.000	288,152.340	
US T N/B 4.25 12/31/25	1,000,000.000	988,535.160	
US T N/B 4.375 02/15/38	300,000.000	297,222.650	
US T N/B 4.375 05/15/34	4,000,000.000	3,970,937.520	
US T N/B 4.375 05/15/40	800,000.000	782,656.240	
US T N/B 4.375 05/15/41	500,000.000	486,328.120	
US T N/B 4.375 08/15/26	3,700,000.000	3,665,457.020	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,700,000.000	2,588,466.800	
US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,477,919.930	
US T N/B 4.375 11/15/39	700,000.000	686,847.650	
US T N/B 4.375 11/30/28	4,300,000.000	4,276,232.430	
US T N/B 4.375 11/30/30	2,700,000.000	2,684,179.670	
US T N/B 4.375 12/15/26	3,970,000.000	3,935,417.560	
US T N/B 4.5 02/15/36	430,000.000	434,551.940	
US T N/B 4.5 02/15/44	2,500,000.000	2,435,351.550	
US T N/B 4.5 03/31/26	5,000,000.000	4,962,597.650	
US T N/B 4.5 04/15/27	3,700,000.000	3,681,789.040	
US T N/B 4.5 05/15/27	5,000,000.000	4,976,367.200	
US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	601,382.790	
US T N/B 4.5 07/15/26	3,400,000.000	3,376,625.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	530,000.000	527,991.790	
US T N/B 4.5 11/15/25	1,700,000.000	1,687,250.000	
US T N/B 4.5 11/15/33	7,800,000.000	7,814,015.660	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,000,000.000	1,008,125.000	
US T N/B 4.625 02/28/26	4,000,000.000	3,977,421.880	
US T N/B 4.625 03/15/26	8,532,000.000	8,485,673.880	
US T N/B 4.625 04/30/29	4,000,000.000	4,022,500.000	
US T N/B 4.625 04/30/31	4,000,000.000	4,036,562.480	
US T N/B 4.625 05/15/44	1,000,000.000	992,500.000	
US T N/B 4.625 05/15/54	2,300,000.000	2,312,218.750	
US T N/B 4.625 06/30/25	1,000,000.000	994,620.710	
US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,486,259.770	
US T N/B 4.625 09/30/28	3,000,000.000	3,010,312.500	
US T N/B 4.625 09/30/30	2,500,000.000	2,519,628.900	
US T N/B 4.625 10/15/26	4,000,000.000	3,985,937.520	
US T N/B 4.625 11/15/26	4,010,000.000	3,996,842.180	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,500,000.000	1,527,539.070	
US T N/B 4.75 07/31/25	1,400,000.000	1,394,339.840	
US T N/B 4.75 11/15/43	2,500,000.000	2,516,406.250	
US T N/B 4.75 11/15/53	4,830,000.000	4,954,523.420	

	US T N/B 4.875 04/30/26	4,500,000.000	4,497,011.730	
	US T N/B 4.875 10/31/28	3,500,000.000	3,547,578.120	
	US T N/B 4.875 10/31/30	2,500,000.000	2,554,248.050	
	US T N/B 4.875 11/30/25	2,000,000.000	1,995,039.060	
	US T N/B 5.0 05/15/37	600,000.000	633,046.870	
	US T N/B 5.0 09/30/25	2,500,000.000	2,496,972.650	
	US T N/B 5.0 10/31/25	1,000,000.000	998,964.840	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,810,000.000	2,863,126.560	
アメリカ・ドル	小計	802,382,000.000 (126,238,760,060)	718,331,306.150 (113,015,064,395)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,000,000.000	933,340.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,180,000.000	1,017,717.610	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,850,000.000	1,406,555.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,050,000.000	1,866,497.650	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,250,000.000	988,562.500	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,850,000.000	1,565,052.090	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	670,000.000	193,362.000	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	700,000.000	672,168.000	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,500,000.000	1,008,150.000	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,350,000.000	526,500.000	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	810,000.000	391,554.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,000,000.000	1,488,440.000	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	900,000.000	760,436.060	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	1,800,000.000	1,425,150.000	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,600,000.000	1,016,800.000	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	920,000.000	322,920.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	910,000.000	829,928.190	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,330,000.000	629,755.000	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,530,000.000	916,623.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,840,000.000	1,733,519.200	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,500,000.000	823,650.000	
	UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,490,000.000	736,060.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	800,000.000	719,790.030	

UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,100,000.000	556,710.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,350,000.000	599,670.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	530,000.000	302,100.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,000,000.000	513,731.600	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,200,000.000	875,400.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	670,000.000	647,863.200	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	870,000.000	534,702.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,050,000.000	853,545.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,250,000.000	2,085,885.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,320,000.000	1,106,688.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,000,000.000	794,400.000	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,350,000.000	1,326,963.870	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,800,000.000	1,657,489.320	
UK TREASURY 3.75 03/07/27	1,000,000.000	979,119.910	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	822,075.000	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,920,000.000	1,617,792.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,000,000.000	883,400.000	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	800,000.000	787,556.320	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	850,000.000	747,320.000	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,350,000.000	2,325,692.070	
UK TREASURY 4.125 07/22/29	500,000.000	496,330.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,050,000.000	1,033,830.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,400,000.000	1,405,663.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	885,132.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,000,000.000	998,300.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,300,000.000	1,241,890.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,260,000.000	1,174,320.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,050,000.000	973,225.260	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	800,000.000	737,738.960	

	UK TREASURY 4.375 07/31/54	1,000,000.000	939,468.400	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,930,000.000	1,940,132.500	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,000,000.000	1,012,300.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,420,000.000	1,387,340.000	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,850,000.000	1,893,678.500	
	UK TREASURY 4.75 10/22/43	900,000.000	902,880.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,400,000.000	1,445,612.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	960,000.000	979,584.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	900,000.000	965,586.600	
イギリス・ボンド 小計		75,850,000.000 (15,190,479,500)	62,403,644.840 (12,497,577,952)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	2,300,000.000	2,152,482.600	
	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	1,050,000.000	1,007,949.600	
	ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	620,000.000	567,851.800	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,410,000.000	1,956,517.530	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,870,000.000	1,435,305.410	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,985,000.000	1,311,362.460	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	530,000.000	513,538.200	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,090,000.000	677,068.760	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,800,000.000	1,682,469.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,800,000.000	1,634,698.800	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,780,000.000	1,400,231.660	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	1,000,000.000	973,729.000	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,155,000.000	1,186,332.840	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	830,000.000	862,445.530	
イスラエル・シュケル 小計		20,220,000.000 (849,432,090)	17,361,983.190 (729,368,233)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	600,000.000	567,607.830	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	2,220,000.000	2,055,821.230	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,970,000.000	1,580,475.280	

	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,110,000.000	917,693.350	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,050,000.000	1,651,734.280	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,170,000.000	987,000.110	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,280,000.000	716,143.810	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,800,000.000	1,491,774.850	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,200,000.000	1,128,203.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,940,000.000	1,786,952.750	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	650,000.000	515,768.730	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,100,000.000	954,803.080	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,220,000.000	1,175,240.430	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,050,000.000	1,000,642.230	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,090,000.000	1,025,688.160	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,030,000.000	797,668.970	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,200,000.000	1,087,654.930	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,250,000.000	1,212,212.840	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	930,000.000	812,032.260	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,180,000.000	1,106,202.620	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	783,606.880	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,800,000.000	1,731,539.350	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,280,000.000	1,285,936.250	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,310,000.000	1,340,462.080	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,640,000.000	1,677,328.850	
	AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	470,000.000	482,290.400	
	オーストラリア・ドル 小計	33,370,000.000 (3,467,143,000)	29,872,484.550 (3,103,751,145)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 03/15/26	50,000,000.000	50,206,980.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27	76,000,000.000	76,278,889.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	7,000,000.000	7,004,341.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	48,500,000.000	48,841,226.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	15,000,000.000	15,072,145.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	4,500,000.000	4,535,054.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	42,500,000.000	42,915,497.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	58,500,000.000	58,788,381.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	50,000,000.000	50,742,790.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	5,000,000.000	5,059,747.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	17,000,000.000	17,207,746.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	15,000,000.000	15,213,982.500	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	4,400,000.000	4,472,842.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28	2,500,000.000	2,544,057.250	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	30,500,000.000	31,020,326.950	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	18,500,000.000	18,827,057.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	15,500,000.000	15,830,587.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	10,000,000.000	10,215,076.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	10,000,000.000	10,234,470.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	18,000,000.000	18,440,456.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	4,500,000.000	4,598,768.250	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	12,000,000.000	12,310,645.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	18,000,000.000	18,511,668.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	24,100,000.000	24,844,297.170	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	34,500,000.000	35,521,206.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	38,000,000.000	38,711,941.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	10,500,000.000	10,818,237.150	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	6,100,000.000	6,298,187.170	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	2,300,000.000	2,381,961.880	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	14,000,000.000	14,476,523.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	58,000,000.000	60,108,363.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	58,000,000.000	59,631,366.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	15,000,000.000	15,699,025.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	7,000,000.000	7,313,240.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	19,000,000.000	20,773,266.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	32,000,000.000	33,285,011.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	18,500,000.000	19,496,445.150	



	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25	11,500,000.000	11,711,877.150	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	40,200,000.000	41,112,640.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	4,000,000.000	4,424,098.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	1,000,000.000	1,127,001.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	6,700,000.000	6,906,024.330	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	16,500,000.000	17,299,203.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	7,900,000.000	9,036,138.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	10,500,000.000	12,421,515.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.69 05/17/28	30,000,000.000	32,210,856.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	4,300,000.000	5,233,093.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	23,500,000.000	28,932,422.150	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	29,500,000.000	36,381,078.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	4,000,000.000	5,088,175.600	
	オフショア・人民元 小計	1,059,500,000.000 (22,926,732,400)	1,100,115,936.150 (23,805,628,766)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,550,000.000	1,454,463.310	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,000,000.000	956,301.930	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,770,000.000	1,468,353.700	
	CANADA 1.0 06/01/27	710,000.000	658,052.650	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,010,000.000	949,003.960	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,850,000.000	1,732,575.030	
	CANADA 1.25 06/01/30	2,320,000.000	2,044,815.480	
	CANADA 1.5 06/01/26	600,000.000	572,807.940	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,550,000.000	2,239,707.700	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,700,000.000	1,479,560.590	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,450,000.000	1,687,798.520	
	CANADA 2.0 06/01/28	380,000.000	358,876.430	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,300,000.000	1,165,885.400	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,520,000.000	1,872,408.780	
	CANADA 2.25 06/01/29	260,000.000	246,331.150	
	CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	471,858.130	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,120,000.000	1,039,006.550	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,000,000.000	942,991.530	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,100,000.000	1,070,353.720	
	CANADA 2.75 12/01/48	550,000.000	485,849.430	
	CANADA 2.75 12/01/55	900,000.000	784,151.860	

	CANADA 2.75 12/01/64	340,000.000	293,373.040	
	CANADA 3.0 04/01/26	650,000.000	638,818.470	
	CANADA 3.0 06/01/34	1,650,000.000	1,580,667.710	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,000,000.000	988,096.400	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,200,000.000	1,175,889.450	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,100,000.000	1,096,156.600	
	CANADA 3.5 03/01/34	400,000.000	400,638.190	
	CANADA 3.5 08/01/25	1,000,000.000	990,865.060	
	CANADA 3.5 09/01/29	300,000.000	299,938.360	
	CANADA 3.5 12/01/45	660,000.000	660,758.210	
	CANADA 4.0 03/01/29	1,700,000.000	1,734,992.490	
	CANADA 4.0 05/01/26	1,920,000.000	1,920,240.510	
	CANADA 4.0 06/01/41	450,000.000	477,234.810	
	CANADA 4.0 08/01/26	1,500,000.000	1,502,876.580	
	CANADA 4.5 02/01/26	2,300,000.000	2,314,095.930	
	CANADA 4.5 11/01/25	200,000.000	200,735.320	
	CANADA 5.0 06/01/37	500,000.000	576,295.310	
	CANADA 5.75 06/01/29	550,000.000	607,688.640	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,000,000.000	1,171,910.200	
カナダ・ドル	小計	45,560,000.000 (5,207,508,000)	42,312,425.070 (4,836,310,186)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	140,000.000	134,288.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	650,000.000	618,585.500	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	750,000.000	672,000.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	400,000.000	308,840.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	530,000.000	406,642.500	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	860,000.000	838,586.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	420,000.000	376,320.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	448,000.000	442,713.600	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	390,000.000	348,652.200	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	560,000.000	546,840.000	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	350,000.000	333,550.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	560,000.000	519,506.400	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	310,000.000	304,265.000	
	SINGAPORE 2.875 08/01/28	100,000.000	98,500.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	197,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	450,000.000	439,425.000	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	200,000.000	197,896.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	427,000.000	410,560.500	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	600,000.000	604,200.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	803,200.000	
シンガポール・ドル	小計	9,145,000.000 (1,063,289,150)	8,601,970.700 (1,000,151,133)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,200,000.000	3,602,325.830	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,480,000.000	4,193,945.850	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	4,090,000.000	3,785,774.500	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	5,100,000.000	4,906,301.320	

	SWEDEN 1.75 11/11/33	4,170,000.000	3,955,799.100	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,600,000.000	2,574,905.490	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	2,740,000.000	3,089,267.800	
スウェーデン・クローナ 小計		27,380,000.000 (410,700,000)	26,108,319.890 (391,624,798)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	3,310,000.000	2,741,805.400	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,130,000.000	2,113,447.990	
	DENMARK 0.5 11/15/27	3,620,000.000	3,360,001.090	
	DENMARK 0.5 11/15/29	3,540,000.000	3,169,566.070	
	DENMARK 1.75 11/15/25	4,250,000.000	4,172,238.030	
	DENMARK 2.25 11/15/33	3,250,000.000	3,142,264.120	
	DENMARK 4.5 11/15/39	6,640,000.000	8,017,053.000	
デンマーク・クローネ 小計		28,740,000.000 (652,398,000)	26,716,375.700 (606,461,728)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	740,000.000	624,650.350	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	570,000.000	524,304.270	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	500,000.000	409,975.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	420,000.000	265,453.230	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	740,000.000	610,283.710	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	410,000.000	327,277.110	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	540,000.000	361,157.370	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	430,000.000	400,580.900	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	770,000.000	703,394.380	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	450,000.000	432,722.710	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	550,000.000	546,668.140	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	340,000.000	338,416.300	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	280,000.000	273,238.090	
	NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	220,000.000	218,906.780	
ニュージーランド・ドル 小計		6,960,000.000 (671,013,600)	6,037,028.340 (582,029,902)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,620,000.000	2,225,952.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	2,910,000.000	2,551,622.580	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,600,000.000	3,456,765.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,350,000.000	3,181,655.800	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,220,000.000	2,935,191.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,560,000.000	2,411,392.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,850,000.000	2,554,248.370	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,890,000.000	3,694,333.000	
	NORWAY 3.5 10/06/42	1,570,000.000	1,557,498.870	
NORWAY 3.625 04/13/34	1,790,000.000	1,781,743.670		
ノルウェー・クローネ 小計		28,360,000.000 (419,160,800)	26,350,402.290 (389,458,946)	

ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,980,000.000	2,654,044.620	
	POLAND 04/25/26	1,700,000.000	1,549,975.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,300,000.000	1,771,296.120	
	POLAND 1.75 04/25/32	1,900,000.000	1,433,070.250	
	POLAND 10/25/25	1,000,000.000	934,535.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,690,000.000	2,543,849.610	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,250,000.000	2,986,101.620	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,810,000.000	1,644,439.300	
	POLAND 2.75 10/25/29	3,000,000.000	2,611,781.240	
	POLAND 3.25 07/25/25	900,000.000	883,184.620	
	POLAND 3.75 05/25/27	2,470,000.000	2,364,327.220	
	POLAND 4.75 07/25/29	2,200,000.000	2,117,161.170	
	POLAND 5.75 04/25/29	2,700,000.000	2,717,175.240	
	POLAND 6.0 10/25/33	3,660,000.000	3,725,038.200	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,800,000.000	2,999,311.000	
ポーランド・ズロチ 小計		35,360,000.000 (1,384,290,960)	32,935,290.210 (1,289,367,209)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,300,000.000	1,207,351.860	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,900,000.000	1,896,368.810	
	MALAYSIA 3.519 04/20/28	500,000.000	497,996.550	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	900,000.000	882,099.520	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	1,400,000.000	1,405,042.380	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,446,564.110	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,000,000.000	1,992,264.240	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	710,000.000	708,220.420	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,630,000.000	1,646,332.920	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	870,000.000	877,924.830	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,300,000.000	1,313,223.210	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,590,000.000	1,605,679.460	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	970,000.000	978,647.930	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	500,000.000	503,588.450	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	700,000.000	703,390.450	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,430,000.000	1,395,359.270	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	800,000.000	819,784.480	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,050,000.000	1,077,478.290	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	500,000.000	508,271.450	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	900,000.000	933,017.120	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,100,000.000	2,181,289.950	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	520,000.000	539,484.710	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,220,000.000	2,352,153.270	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,600,000.000	1,717,975.520	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	700,000.000	754,719.700	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,290,802.560		
MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,330,000.000	1,454,503.560		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,180,000.000	1,306,079.570		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	700,000.000	771,874.600		
マレーシア・リングgit 小計		34,000,000.000	34,767,489.190	

		(1,132,393,800)	(1,157,955,565)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	8,000,000.000	7,547,360.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	27,200,000.000	24,217,792.000	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	2,000,000.000	1,714,120.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	18,780,000.000	16,250,334.000	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	18,650,000.000	15,389,793.500	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	15,000,000.000	13,980,900.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	4,700,000.000	4,768,056.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	24,150,000.000	22,329,897.090	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	24,730,000.000	22,995,437.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	25,080,000.000	22,218,121.200	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,220,000.000	16,633,376.400	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	6,191,000.000	5,386,851.010	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	18,596,000.000	15,500,509.840	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	19,201,000.000	18,034,155.230	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	16,300,000.000	14,683,529.000		
メキシコ・ペソ 小計		248,798,000.000 (2,128,193,212)	221,650,233.070 (1,895,973,929)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	850,000.000	716,819.230	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	880,000.000	718,189.560	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	1,100,000.000	966,103.870	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	920,000.000	537,556.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	600,000.000	417,240.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	600,000.000	534,361.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	900,000.000	837,658.800	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	210,000.000	89,015.850	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	950,000.000	875,790.270	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	620,000.000	343,695.620	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,020,000.000	966,179.700	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	350,000.000	147,950.250	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	440,000.000	374,268.940	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	300,000.000	291,641.250	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	640,000.000	455,395.120	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	85,500.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	500,000.000	376,116.250	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	670,000.000	654,899.870	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	277,999.310	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	510,000.000	476,455.150	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,400,000.000	1,373,133.290		
AUSTRIA 2.9 02/20/34	580,000.000	565,616.000		

AUSTRIA 2.9 05/23/29	200,000.000	199,083.550	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	520,000.000	505,904.090	
AUSTRIA 3.15 10/20/53	350,000.000	336,420.000	
AUSTRIA 3.45 10/20/30	400,000.000	408,800.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	180,000.000	198,160.650	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	850,000.000	926,978.120	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	850,000.000	873,284.050	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	580,000.000	632,972.670	
BELGIUM 0.0 10/22/27	750,000.000	677,767.950	
BELGIUM 0.0 10/22/31	800,000.000	639,786.000	
BELGIUM 0.1 06/22/30	900,000.000	756,450.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,100,000.000	884,840.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	930,000.000	579,515.550	
BELGIUM 0.65 06/22/71	520,000.000	202,999.220	
BELGIUM 0.8 06/22/25	600,000.000	584,078.880	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,170,000.000	1,093,743.780	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,000,000.000	915,000.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,150,000.000	1,038,132.300	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,000,000.000	957,322.300	
BELGIUM 1.0 06/22/31	850,000.000	739,766.250	
BELGIUM 1.25 04/22/33	900,000.000	770,922.000	
BELGIUM 1.4 06/22/53	580,000.000	348,864.200	
BELGIUM 1.45 06/22/37	500,000.000	400,820.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	500,000.000	344,506.250	
BELGIUM 1.7 06/22/50	610,000.000	412,948.650	
BELGIUM 1.9 06/22/38	700,000.000	581,066.500	
BELGIUM 2.15 06/22/66	530,000.000	375,505.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	450,000.000	330,440.400	
BELGIUM 2.7 10/22/29	400,000.000	393,401.400	
BELGIUM 2.75 04/22/39	400,000.000	367,069.000	
BELGIUM 2.85 10/22/34	500,000.000	481,969.500	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,300,000.000	1,282,018.270	
BELGIUM 3.0 06/22/34	640,000.000	627,817.600	
BELGIUM 3.3 06/22/54	720,000.000	669,009.600	
BELGIUM 3.45 06/22/43	500,000.000	491,011.000	
BELGIUM 3.5 06/22/55	450,000.000	431,932.500	
BELGIUM 3.75 06/22/45	600,000.000	613,617.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	650,000.000	688,956.450	
BELGIUM 4.25 03/28/41	750,000.000	818,084.400	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,580,000.000	1,614,362.150	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,380,000.000	1,591,708.690	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,360,000.000	1,478,138.030	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	2,180,000.000	2,063,043.000	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,290,000.000	1,190,295.900	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,000,000.000	1,868,500.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	800,000.000	767,040.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	500,000.000	479,450.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,960,000.000	1,867,292.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	700,000.000	667,226.000	

BUNDESUBL 2.1 04/12/29	1,300,000.000	1,264,198.000	
BUNDESUBL 2.2 04/13/28	1,240,000.000	1,214,542.800	
BUNDESUBL 2.4 10/19/28	1,650,000.000	1,627,279.500	
BUNDESSCHAT 2.5 03/19/26	2,200,000.000	2,175,580.000	
BUNDESSCHAT 2.8 06/12/25	600,000.000	596,550.000	
BUNDESSCHAT 2.9 06/18/26	1,000,000.000	996,350.000	
BUNDESSCHAT 3.1 12/12/25	800,000.000	798,400.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,600,000.000	1,380,976.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,600,000.000	1,347,424.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,080,000.000	1,706,416.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,520,000.000	1,134,421.600	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,700,000.000	1,230,698.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,350,000.000	2,004,526.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	820,000.000	699,665.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,500,000.000	1,247,955.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	666,087.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,920,000.000	937,376.640	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	760,000.000	372,065.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,360,000.000	1,095,087.200	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,300,000.000	1,183,273.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,950,000.000	1,734,117.930	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,200,000.000	2,053,150.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,550,000.000	1,387,547.600	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,750,000.000	1,582,892.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,100,000.000	2,968,405.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,710,000.000	1,577,406.600	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,500,000.000	2,327,481.250	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,750,000.000	2,580,060.310	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,750,000.000	1,528,888.800	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,850,000.000	1,468,974.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	830,000.000	808,088.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,020,000.000	1,472,186.100	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,800,000.000	1,678,554.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	2,120,000.000	1,700,812.400	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	500,000.000	401,770.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,700,000.000	1,649,612.000	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	2,100,000.000	2,015,874.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	2,560,000.000	2,489,241.600	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	500,000.000	487,025.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,200,000.000	1,181,376.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,900,000.000	1,800,687.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,200,000.000	2,080,028.490	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	600,000.000	563,394.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	2,210,000.000	2,199,789.800	

DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,200,000.000	1,267,944.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,050,000.000	2,315,402.220	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,390,000.000	1,631,095.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,000,000.000	1,076,000.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,180,000.000	1,390,771.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,420,000.000	1,769,433.600	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,290,000.000	1,505,739.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,500,000.000	1,641,810.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	800,000.000	944,712.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	970,000.000	1,071,704.500	
FINLAND 0.0 09/15/26	550,000.000	512,270.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	280,000.000	231,884.100	
FINLAND 0.125 04/15/36	190,000.000	132,125.240	
FINLAND 0.125 04/15/52	370,000.000	162,683.450	
FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	243,042.300	
FINLAND 0.25 09/15/40	400,000.000	247,572.900	
FINLAND 0.5 04/15/26	500,000.000	476,425.500	
FINLAND 0.5 04/15/43	190,000.000	115,736.120	
FINLAND 0.5 09/15/27	350,000.000	322,601.380	
FINLAND 0.5 09/15/28	520,000.000	467,788.280	
FINLAND 0.5 09/15/29	500,000.000	439,002.250	
FINLAND 0.75 04/15/31	300,000.000	257,772.150	
FINLAND 0.875 09/15/25	450,000.000	436,616.030	
FINLAND 1.125 04/15/34	400,000.000	331,433.700	
FINLAND 1.375 04/15/27	200,000.000	190,613.300	
FINLAND 1.375 04/15/47	320,000.000	222,490.240	
FINLAND 1.5 09/15/32	500,000.000	441,448.750	
FINLAND 2.625 07/04/42	470,000.000	425,784.510	
FINLAND 2.75 04/15/38	260,000.000	243,484.750	
FINLAND 2.75 07/04/28	400,000.000	395,771.200	
FINLAND 2.875 04/15/29	400,000.000	396,400.000	
FINLAND 2.95 04/15/55	150,000.000	139,485.000	
FINLAND 3.0 09/15/33	420,000.000	414,239.070	
FINLAND 3.0 09/15/34	300,000.000	294,626.400	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,300,000.000	3,124,049.210	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,900,000.000	2,667,060.400	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,150,000.000	2,467,395.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,900,000.000	3,310,881.600	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,180,000.000	3,440,684.440	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,300,000.000	2,629,003.080	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,930,000.000	2,731,064.440	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,530,000.000	3,350,702.470	



FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,980,000.000	3,517,812.550	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,610,000.000	1,032,340.050	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	530,000.000	188,673.640	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,320,000.000	756,140.210	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,730,000.000	2,510,174.940	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,200,000.000	3,842,575.800	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,000,000.000	1,015,005.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,950,000.000	966,075.820	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,040,000.000	2,751,038.880	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,920,000.000	2,748,290.130	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	800,000.000	773,953.890	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,350,000.000	1,958,628.060	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,790,000.000	2,224,746.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,550,000.000	1,179,240.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,200,000.000	3,792,028.800	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,870,000.000	1,220,945.440	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,500,000.000	941,154.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,110,000.000	1,702,843.850	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,650,000.000	1,237,012.920	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	3,600,000.000	3,295,669.500	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,350,000.000	3,250,461.980	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,300,000.000	1,113,721.700	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,500,000.000	4,430,626.860	
FRANCE OAT 2.5 09/24/27	2,500,000.000	2,452,072.250	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	2,700,000.000	2,661,548.610	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,790,000.000	3,747,290.490	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	2,100,000.000	2,069,697.000	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,650,000.000	1,460,072.620	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	800,000.000	726,896.970	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,500,000.000	2,393,878.750	
FRANCE OAT 3.25 05/25/55	800,000.000	740,680.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,320,000.000	2,330,861.080	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	4,000,000.000	4,089,844.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,350,000.000	1,441,948.500	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,200,000.000	1,292,384.640	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,900,000.000	2,026,497.250	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,510,000.000	2,836,318.820	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,680,000.000	1,904,175.840	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,690,000.000	2,980,671.170	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	1,710,000.000	2,029,149.270	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,070,000.000	1,106,783.920	
IRISH 0.0 10/18/31	430,000.000	347,023.280	
IRISH 0.2 05/15/27	650,000.000	599,349.070	
IRISH 0.2 10/18/30	400,000.000	338,002.830	
IRISH 0.35 10/18/32	530,000.000	427,941.470	
IRISH 0.4 05/15/35	450,000.000	338,666.620	
IRISH 0.55 04/22/41	240,000.000	156,196.440	
IRISH 0.9 05/15/28	650,000.000	601,524.580	
IRISH 1.0 05/15/26	510,000.000	489,929.860	

IRISH 1.1 05/15/29	500,000.000	458,416.130	
IRISH 1.3 05/15/33	620,000.000	537,792.650	
IRISH 1.35 03/18/31	300,000.000	271,369.500	
IRISH 1.5 05/15/50	565,000.000	389,563.950	
IRISH 1.7 05/15/37	350,000.000	294,828.950	
IRISH 2.0 02/18/45	630,000.000	510,794.860	
IRISH 2.4 05/15/30	730,000.000	708,515.000	
IRISH 2.6 10/18/34	250,000.000	239,758.300	
IRISH 3.0 10/18/43	300,000.000	288,433.560	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,450,000.000	1,361,985.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,700,000.000	1,578,110.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,230,000.000	1,090,764.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	900,000.000	780,615.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,500,000.000	1,427,730.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,300,000.000	1,152,710.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,700,000.000	1,367,525.900	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	2,200,000.000	2,058,540.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,750,000.000	1,454,910.620	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,100,000.000	754,160.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,350,000.000	1,086,345.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,300,000.000	1,105,520.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,600,000.000	1,476,960.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,400,000.000	1,144,858.750	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,000,000.000	936,650.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	600,000.000	583,326.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,660,000.000	1,573,229.720	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,400,000.000	1,232,901.600	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,030,000.000	777,444.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	840,000.000	514,080.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	900,000.000	882,300.370	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,000,000.000	1,928,400.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,400,000.000	1,201,698.400	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,300,000.000	1,146,343.900	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,100,000.000	644,718.250	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	900,000.000	632,160.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	460,000.000	451,904.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,300,000.000	1,234,249.310	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	500,000.000	489,126.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	900,000.000	862,200.000	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,400,000.000	1,360,798.600	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	150,000.000	87,600.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,000,000.000	640,300.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,000,000.000	1,929,000.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,200,000.000	984,480.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	780,000.000	692,344.960	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	840,000.000	587,748.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	400,000.000	394,382.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,300,000.000	1,173,770.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,100,000.000	1,070,190.000	

ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,180,000.000	896,682.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	750,000.000	529,275.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.000	963,900.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,200,000.000	1,164,484.800	
ITALY BTPS 2.95 02/15/27	1,050,000.000	1,035,195.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	980,000.000	844,858.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,200,000.000	1,167,330.600	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	800,000.000	689,726.000	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	1,030,000.000	923,807.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,200,000.000	1,006,221.600	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,100,000.000	1,031,794.500	
ITALY BTPS 3.35 07/01/29	900,000.000	889,200.000	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,250,000.000	1,245,000.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	960,000.000	825,502.310	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	700,000.000	699,230.000	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	1,200,000.000	1,181,880.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,940,000.000	1,927,875.000	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,110,000.000	1,109,445.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,700,000.000	1,707,660.030	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	1,400,000.000	1,413,300.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	750,000.000	683,489.430	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,820,000.000	1,832,922.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,600,000.000	1,616,000.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,250,000.000	2,223,225.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	700,000.000	697,270.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,000,000.000	1,015,500.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,014,600.000	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	1,000,000.000	985,400.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	800,000.000	817,600.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	700,000.000	686,490.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,400,000.000	1,424,640.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	1,430,000.000	1,471,899.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,440,000.000	1,491,984.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	500,000.000	500,800.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,500,000.000	1,523,850.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	900,000.000	896,760.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,300,000.000	1,360,879.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.000	1,459,642.800	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,930,000.000	2,087,488.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,860,000.000	1,997,454.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,890,000.000	2,026,836.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,390,000.000	1,503,146.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,820,000.000	2,062,242.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,170,000.000	2,471,630.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,870,000.000	2,048,772.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,500,000.000	1,627,500.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	500,000.000	475,653.310	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,540,000.000	1,425,940.370	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	700,000.000	613,778.370	

NETHERLANDS 0.0 01/15/38	900,000.000	597,611.840	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,420,000.000	643,391.340	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,100,000.000	925,668.700	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	880,000.000	720,296.510	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	900,000.000	870,711.520	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	700,000.000	613,942.000	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	970,000.000	667,186.850	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,650,000.000	1,565,355.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	700,000.000	580,403.630	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	935,829.700	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,310,000.000	1,202,832.170	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	790,000.000	637,478.680	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	800,000.000	783,620.400	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	820,000.000	794,785.820	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	1,000,000.000	964,961.250	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	700,000.000	670,390.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,330,000.000	1,274,301.590	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	350,000.000	360,202.320	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,200,000.000	1,311,362.510	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	800,000.000	879,200.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,020,000.000	1,107,720.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	400,000.000	379,498.500	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,400,000.000	2,206,800.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,950,000.000	1,743,300.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	800,000.000	773,516.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,790,000.000	1,442,024.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,400,000.000	1,203,508.040	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,300,000.000	1,070,237.350	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,780,000.000	1,558,932.010	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,350,000.000	1,112,811.750	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,800,000.000	1,676,700.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	2,200,000.000	1,961,190.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,460,000.000	1,038,481.210	
SPAIN 1.0 07/30/42	600,000.000	382,020.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,830,000.000	968,527.500	
SPAIN 1.2 10/31/40	900,000.000	618,663.370	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,000,000.000	1,781,000.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,690,000.000	2,574,505.160	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,050,000.000	1,922,224.000	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,400,000.000	1,310,120.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,230,000.000	1,138,054.420	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,800,000.000	1,703,242.710	

SPAIN 1.45 10/31/71	550,000.000	261,245.600	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,440,000.000	2,327,272.000	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,100,000.000	933,728.950	
SPAIN 1.9 10/31/52	1,580,000.000	1,033,154.490	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,940,000.000	1,894,031.210	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,160,000.000	1,083,123.030	
SPAIN 2.15 10/31/25	550,000.000	541,398.080	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,610,000.000	1,473,794.000	
SPAIN 2.5 05/31/27	700,000.000	686,035.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,300,000.000	1,228,457.100	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,200,000.000	975,693.000	
SPAIN 2.8 05/31/26	2,600,000.000	2,575,040.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,270,000.000	1,086,337.040	
SPAIN 3.15 04/30/33	2,000,000.000	1,968,457.000	
SPAIN 3.25 04/30/34	1,700,000.000	1,672,329.100	
SPAIN 3.45 07/30/43	1,100,000.000	1,036,972.200	
SPAIN 3.45 07/30/66	690,000.000	610,840.700	
SPAIN 3.5 05/31/29	1,000,000.000	1,015,743.000	
SPAIN 3.55 10/31/33	1,220,000.000	1,233,908.000	
SPAIN 3.9 07/30/39	1,100,000.000	1,117,763.350	
SPAIN 4.0 10/31/54	300,000.000	298,386.930	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,080,000.000	1,146,448.080	
SPAIN 4.65 07/30/25	400,000.000	405,423.200	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,800,000.000	2,006,078.400	
SPAIN 4.9 07/30/40	930,000.000	1,048,110.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	1,000,000.000	1,083,800.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	900,000.000	1,061,857.080	
SPAIN 5.75 07/30/32	2,000,000.000	2,348,450.000	
SPAIN 5.9 07/30/26	1,600,000.000	1,685,482.400	
SPAIN 6.0 01/31/29	1,800,000.000	2,021,917.500	
ユーロ 小計	478,435,000.000 (81,013,398,550)	437,962,351.920 (74,160,165,051)	
国債証券 合計	262,754,893,122.200 (262,754,893,122)	239,460,888,938 (239,460,888,938)	
合計		239,460,888,938 (239,460,888,938)	

(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 270銘柄	46.69	47.20
イギリス・ポンド	国債証券 61銘柄	5.16	5.22
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.30	0.30
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	1.28	1.30
オフショア・人民元	国債証券 50銘柄	9.84	9.94

カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	2.00	2.02
シンガポール・ドル	国債証券	20銘柄	0.41	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.16	0.16
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.25	0.25
ニュージーランド・ドル	国債証券	14銘柄	0.24	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.16	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	0.53	0.54
マレーシア・リンギット	国債証券	29銘柄	0.48	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.78	0.79
ユーロ	国債証券	376銘柄	30.64	30.97

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	189,550,340
コール・ローン	62,158,011
投資信託受益証券	9,313,112,876
投資証券	76,262,146,576
派生商品評価勘定	287,619
未収入金	1,984,193
未収配当金	145,283,030
差入委託証拠金	424,582,958
流動資産合計	86,399,105,603
資産合計	86,399,105,603
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,166,256
未払金	33,601,194
未払解約金	5,407,000
流動負債合計	40,174,450
負債合計	40,174,450
純資産の部	
元本等	
元本	42,581,838,025
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	43,777,093,128
元本等合計	86,358,931,153
純資産合計	86,358,931,153
負債純資産合計	86,399,105,603

## 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12月12日 至 2024年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	46,744,560,535円
同期中追加設定元本額	7,059,931,619円
同期中一部解約元本額	11,222,654,129円
元本の内訳 ファンド名	
たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	3,732,619,654円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,509,428円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	16,121,852円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	40,736,216円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	45,898,769円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	53,063,731円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	27,197,441円
たわらノーロード 先進国リート	15,342,319,867円
たわらノーロード 先進国リート＜ラップ向け＞	128,006,048円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	256,112,028円



たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,248,673,658円
たわらノーロード バランス(堅実型)	26,728,469円
たわらノーロード バランス(標準型)	618,010,808円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,440,566,176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)	1,255,966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)	626,475,290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)	669,866,512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)	1,188,719,850円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	529,882円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	40,123,770円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	13,281,399円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	33,179,476円
One DC 先進国リートインデックスファンド	2,250,217,011円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	15,876,493円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	596,420,560円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	79,425,412円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	189,471,408円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	313,572,673円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	612,101,769円
投資のソムリエ	3,856,050,647円
投資のソムリエ<DC年金>	413,259,951円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	271,611,344円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,013,891円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,452,619,453円
ワールドアセットバランス(基本コース)	246,980,107円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	642,800,070円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	62,700,553円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	32,517,082円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,386,291円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	86,191,058円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,215,386,591円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	158,587,271円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	38,983,095円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	34,781,298円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	21,386,379円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,403,231円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	68,811,792円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	276,317,345円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	380,940,780円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	217,802円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	647,540円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	125,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	867,926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)	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	501,108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)	5,202円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	62,054,960円

AM 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)	895,492円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	572,716円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド( F O F s 用)(適格機関投資家専用)	2,239,608円
D I A M 世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	40,118,123円
D I A M 世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	102,167,791円
D I A M グローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	16,902,701円
計	42,581,838,025円
2. 受益権の総数	42,581,838,025口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信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、不動産投資信託証券の価格及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	---

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	862,555,430
投資証券	3,420,775,382
合計	4,283,330,812

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年6月23日から2024年6月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年6月11日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	22,935,760	-	22,935,721	39
イギリス・ポンド	6,006,060	-	6,006,321	261
ユーロ	16,929,700	-	16,929,400	300
買建	29,024,520	-	29,025,320	800
オーストラリア・ドル	15,582,120	-	15,583,050	930
カナダ・ドル	11,428,680	-	11,428,500	180
香港・ドル	2,013,720	-	2,013,770	50
合計	51,960,280	-	51,961,041	839

(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。

## 不動産投信関連

種類	2024年6月11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	716,910,330	-	716,030,854	879,476
合計	716,910,330	-	716,030,854	879,476

## （注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

2024年6月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0281円 (20,281円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

該当事項はありません。

## （2）株式以外の有価証券

2024年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	299,800.000	170,886.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	291,800.000	40,560.200		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	58,730.000		
		PRIME US REIT	349,360.000	41,224.480		
		アメリカ・ドル	小計	1,852,660.000	311,400.680 (48,992,669)	
	オーストラリア・ドル		ABACUS GROUP	168,642.000	193,938.300	
			ABACUS STORAGE KING	224,215.000	269,058.000	
			ARENA REIT	138,778.000	525,968.620	
			BWP TRUST	214,031.000	796,195.320	
			CENTURIA CAPITAL GROUP	308,200.000	536,268.000	
			CENTURIA INDUSTRIAL REIT	213,140.000	684,179.400	
			CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	225,041.850	
		CHARTER HALL GROUP	194,616.000	2,469,677.040		

	CHARTER HALL LONG WALE REIT	265,944.000	941,441.760	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	204,746.000	685,899.100	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	137,586.000	345,340.860	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	520,520.000	221,221.000	
	DEXUS	441,787.000	3,074,837.520	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	93,159.000	276,682.230	
	GDI PROPERTY GROUP	222,442.000	141,250.670	
	GOODMAN GROUP	705,681.000	24,917,596.110	
	GPT GROUP	786,276.000	3,373,124.040	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	101,900.000	245,579.000	
	HEALTHCO REIT	202,023.000	232,326.450	
	HMC CAPITAL LTD	97,142.000	727,593.580	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	745,380.000	916,817.400	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	282,469.530	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	157,084.000	766,569.920	
	MIRVAC GROUP	1,620,072.000	3,232,043.640	
	NATIONAL STORAGE REIT	509,415.000	1,161,466.200	
	REGION RE LTD	466,538.000	1,026,383.600	
	RURAL FUNDS GROUP	148,357.000	299,681.140	
	SCENTRE GROUP	2,123,934.000	6,817,828.140	
	STOCKLAND	976,190.000	4,480,712.100	
	VICINITY CENTRES	1,588,997.000	3,082,654.180	
	WAYPOINT REIT LTD	266,477.000	644,874.340	
	オーストラリア・ドル 小計	14,115,114.000	63,594,719.040 (6,607,491,310)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	273,095.000	346,830.650	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	997,316.000	892,597.820	
	CAPITALAND CHINA TRUST	449,780.000	296,854.800	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,073,609.000	4,085,009.730	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,458,860.000	3,763,858.800	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	277,200.000	267,498.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	15,736.000	
	ESR LOGOS REIT	2,395,840.000	682,814.400	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	464,500.000	283,345.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	472,400.000	1,025,108.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,178,864.000	1,137,603.760	
	KEPPEL DC REIT	537,300.000	956,394.000	
	KEPPEL REIT	910,000.000	773,500.000	

		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	716,600.000	394,130.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	852,620.000	1,858,711.600	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,375,420.000	1,815,554.400	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	957,000.000	1,177,110.000	
		PARAGON REIT	487,100.000	414,035.000	
		PARKWAY LIFE REIT	163,100.000	593,684.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	242,300.000	162,341.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	530,300.000	257,195.500	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	898,090.000	960,956.300	
	シンガポール・ドル 小計		17,823,694.000	22,160,868.760 (2,576,644,211)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	129,840.000	186,969.600	
	ユーロ 小計		129,840.000	186,969.600 (31,659,562)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	591,000.000	2,399,460.000	
	香港・ドル 小計		591,000.000	2,399,460.000 (48,325,124)	
投資信託受益証券 合計			34,512,308	9,313,112,876 (9,313,112,876)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	42,601.000	721,234.930	
		AGREE REALTY CORP	41,152.000	2,473,646.720	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	30,467.000	502,400.830	
		ALEXANDER'S INC.	860.000	180,144.200	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64,360.000	7,331,891.200	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	67,601.280	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	18,786.000	402,771.840	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	130,134.000	4,647,085.140	
		AMERICOLD REALTY TRUST	109,232.000	2,927,417.600	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	59,296.000	2,298,905.920	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	53,077.000	433,639.090	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	86,607.000	1,238,480.100	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	25,650.000	281,124.000	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	13,233.420	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	57,941.000	11,549,958.940	

BOSTON PROPERTIES INC	59,131.000	3,493,459.480	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	66,007.530	
BRANDYWINE REALTY TRUST	65,638.000	296,683.760	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	123,239.000	2,740,835.360	
BROADSTONE NET LEASE INC	75,796.000	1,151,341.240	
BRT APARTMENTS CORP	5,643.000	101,066.130	
CAMDEN PROPERTY TRUST	43,691.000	4,698,093.230	
CARETRUST REIT INC	53,768.000	1,367,320.240	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10,705.000	240,862.500	
CENTERSPACE	6,258.000	421,726.620	
CHATHAM LODGING TRUST	19,711.000	163,009.970	
CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	83,914.970	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	18,970.780	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	99,470.000	324,272.200	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9,794.000	219,875.300	
COPT DEFENCE PROPERTIES	46,331.000	1,118,893.650	
COUSINS PROPERTIES INC	61,058.000	1,395,175.300	
CTO REALTY GROUTH INC	7,420.000	133,040.600	
CUBESMART	92,059.000	3,916,189.860	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	85,756.000	710,917.240	
DIGITAL REALTY TRUST INC	132,137.000	19,700,305.330	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	89,231.000	246,277.560	
DOUGLAS EMMETT INC	69,167.000	917,154.420	
EAST GROUP	19,544.000	3,244,108.560	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	40,047.000	472,154.130	
ELME COMMUNITIES	36,795.000	570,322.500	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	51,841.000	481,084.480	
EPR PROPERTIES	31,062.000	1,250,866.740	
EQUINIX INC	38,398.000	29,279,626.940	
EQUITY COMMONWEALTH	43,229.000	828,699.930	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	76,272.000	4,705,982.400	
EQUITY RESIDENTIAL	141,022.000	9,314,503.100	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	64,159.000	1,761,806.140	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	26,245.000	7,069,615.650	
EXTRA SPACE STORAGE INC	86,290.000	12,925,379.100	
FARMLAND PARTNERS INC	16,653.000	180,351.990	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	30,104.000	3,027,258.240	

FIRST INDUSTRIAL RT	54,255.000	2,506,038.450	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	37,579.000	897,762.310	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,375.000	78,837.500	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	109,237.000	4,747,440.020	
GETTY REALTY CORP	20,570.000	556,624.200	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,124.000	216,121.960	
GLADSTONE LAND CORP	13,328.000	175,929.600	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,662.000	242,357.580	
GLOBAL NET LEASE INC	77,690.000	574,906.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	156,223.000	2,583,928.420	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	289,497.000	5,567,027.310	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	42,731.000	1,073,402.720	
HOST HOTELS & RESORTS INC	288,548.000	5,225,604.280	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	52,743.000	249,474.390	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	92,362.000	1,634,807.400	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	102,685.420	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	11,565.000	1,237,108.050	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	28,156.000	688,132.640	
INVITATION HOMES INC	235,075.000	8,300,498.250	
IRON MOUNTAIN INC	119,293.000	10,390,420.300	
JBG SMITH PROPERTIES	34,530.000	496,541.400	
KILROY REALTY CORP	43,961.000	1,381,694.230	
KIMCO REALTY	272,465.000	5,051,501.100	
KITE REALTY GROUP TRUST	90,116.000	1,987,057.800	
LTC PROPERTIES INC	17,329.000	582,427.690	
LXP INDUSTRIAL TRUST	118,308.000	1,026,913.440	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	246,830.000	1,241,554.900	
MID AMERICA	47,719.000	6,609,081.500	
NATIONAL HEALTH INVS INC	17,553.000	1,132,695.090	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	31,273.000	1,211,516.020	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	5,763.000	134,047.380	
NETSTREIT CORP	28,720.000	479,911.200	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	15,267.000	75,724.320	



NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,716.000	326,327.040	
NNN REIT INC	74,767.000	3,120,026.910	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	52,770.720	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	100,489.000	3,200,574.650	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,830.000	137,762.900	
ORION OFFICE REIT INC	20,368.000	70,880.640	
PARAMOUNT GROUP INC	63,997.000	293,106.260	
PARK HOTELS & RESORTS INC	86,520.000	1,297,800.000	
PEAKSTONE REALTY TRUST	13,637.000	159,143.790	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	48,508.000	663,104.360	
PHILLIPS EDISON & CO INC	50,207.000	1,578,508.080	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,326.000	335,068.080	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,197.000	318,833.060	
POSTAL REALTY TRUST INC	7,238.000	95,758.740	
PROLOGIS INC	377,847.000	42,005,250.990	
PUBLIC STORAGE	64,613.000	17,705,254.260	
REALTY INCOME CORP	340,312.000	17,937,845.520	
REGENCY CENTERS CORP	67,240.000	4,085,502.400	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	52,599.000	653,805.570	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	86,283.000	3,803,354.640	
RLJ LODGING TRUST	62,698.000	613,186.440	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24,487.000	2,448,700.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	95,263.000	1,340,350.410	
SAFEHOLD INC	17,116.000	320,240.360	
SAUL CENTERS INC	4,875.000	175,890.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	69,695.000	349,868.900	
SIMON PROPERTY GROUP INC	133,324.000	20,270,580.960	
SITE CENTERS CORP	72,757.000	1,058,614.350	
SL GREEN	26,662.000	1,424,017.420	
STAG INDUSTRIAL INC	74,467.000	2,603,366.320	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	41,424.000	248,958.240	
SUN COMMUNITIES INC	50,887.000	5,812,822.010	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	82,956.000	832,878.240	
TANGER INC	44,528.000	1,204,927.680	
TERRENO REALTY CORP	38,387.000	2,165,794.540	
THE MACERICH COMPANY	89,002.000	1,311,889.480	

	UDR INC	123,808.000	4,931,272.640	
	UMH PROPERTIES INC	24,455.000	369,270.500	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,814.000	186,927.620	
	URBAN EDGE PROPERTIES	47,399.000	822,846.640	
	VENTAS INC	164,433.000	8,205,206.700	
	VERIS RESIDENTIAL INC	33,670.000	510,100.500	
	VICI PROPERTIES INC	422,535.000	11,877,458.850	
	VORNADO REALTY TRUST	65,917.000	1,587,940.530	
	WELLTOWER INC	226,391.000	23,438,260.230	
	WHITESTONE REIT	18,939.000	247,153.950	
	WP CAREY INC	89,454.000	5,012,107.620	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	42,523.000	608,504.130	
	アメリカ・ドル 小計	9,101,085.000	419,986,275.120 (66,076,440,663)	
イギリス・ポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	134,607.000	71,745.530	
	AEW UK REIT PLC	50,684.000	44,297.810	
	ASSURA PLC	1,209,341.000	481,317.710	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	269,934.000	207,039.370	
	BIG YELLOW GROUP PLC	80,883.000	973,831.320	
	BRITISH LAND CO PLC	385,341.000	1,657,736.980	
	CLS HOLDINGS PLC	45,585.000	40,023.630	
	CUSTODIAN REIT PLC	186,443.000	133,866.070	
	DERWENT LONDON PLC	46,266.000	1,074,296.520	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	244,328.000	227,225.040	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	169,286.000	585,729.560	
	HAMMERSON PLC	1,608,313.000	447,111.010	
	HELICAL PLC	42,126.000	90,570.900	
	HOME REIT PLC	286,621.000	0.000	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	169,602.000	146,705.730	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	308,249.000	1,988,206.050	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	147,597.000	49,740.180	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	835,955.000	1,675,253.820	
	NEWRIVER REIT PLC	113,885.000	80,061.150	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	233,467.000	154,088.220	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	535,453.000	487,262.230	
PRS REIT PLC/THE	210,972.000	164,347.180		
REGIONAL REIT LTD	236,558.000	53,698.660		

	SAFESTORE HOLDINGS LTD	87,913.000	737,150.500	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	203,492.000	90,146.950	
	SEGRE PLC	547,100.000	4,954,537.600	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	804,118.000	1,145,064.030	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	496,398.000	362,866.930	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	252,776.000	194,890.290	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	117,315.000	66,986.860	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	937,637.000	1,467,401.900	
	UNITE GROUP PLC	162,940.000	1,482,754.000	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	190,244.000	229,053.770	
	WAREHOUSE REIT PLC	182,285.000	149,109.130	
	WORKSPACE GROUP PLC	55,710.000	314,761.500	
イギリス・ポンド 小計		11,820,464.000	22,028,878.130 (4,411,723,423)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	293,689.000	473,720.350	
	REIT 1 LTD	80,765.000	1,154,939.500	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	84,461.000	562,932.560	
イスラエル・シュケル 小計		458,915.000	2,191,592.410 (92,067,701)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	25,873.000	426,904.500	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,895.000	143,193.300	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,134.000	710,494.740	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,104.000	127,556.960	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	49,816.290	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	33,918.000	1,494,766.260	
	CHOICE PROPERTIES REIT	64,451.000	819,816.720	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	21,726.000	275,051.160	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,105.000	300,849.050	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	53,218.000	668,418.080	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	2,585.000	50,200.700	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,415.000	611,285.400	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,103.000	816,952.500	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	52,945.000	484,446.750	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	27,652.000	332,100.520	

	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,694.000	412,275.600	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,386.000	112,858.080	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,485.000	101,749.650	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	100,895.900	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	51,343.000	257,741.860	
	PRIMARIS REIT	20,442.000	271,265.340	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,891.000	49,553.910	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	61,026.000	1,037,442.000	
	SLATE GROCERY REIT	12,169.000	135,927.730	
	SMARTCENTRES REIT	28,245.000	630,710.850	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	3,727.000	33,021.220	
	カナダ・ドル 小計	652,410.000	10,455,295.070 (1,195,040,227)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	365,062.000	386,965.720	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	431,888.000	919,921.440	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	641,837.000	539,143.080	
	PRECINCT PROPERTIES	629,766.000	727,379.730	
	ニュージーランド・ドル 小計	2,068,553.000	2,573,409.970 (248,102,455)	
ユーロ	AEDIFICA	19,606.000	1,137,148.000	
	ALTAREA	1,894.000	203,036.800	
	CARE PROPERTY INVEST NV	15,092.000	220,946.880	
	CARMILA SA	22,407.000	384,504.120	
	COFINIMMO SA	14,794.000	873,585.700	
	COVIVIO	19,797.000	953,819.460	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	17,867.000	419,874.500	
	GECINA SA	21,068.000	2,092,052.400	
	HAMBORNER REIT AG	28,721.000	190,133.020	
	ICADE	12,549.000	353,379.840	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	39,218.940	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	115,299.000	711,971.320	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	175,735.000	165,718.100	
	KLEPIERRE	80,046.000	2,142,030.960	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	19,464.000	135,080.160	
MERCIALYS	37,380.000	433,608.000		

	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	137,189.000	1,487,128.760	
	MONTEA SCA	7,158.000	588,387.600	
	NSI NV	7,519.000	148,425.060	
	RETAIL ESTATES	4,857.000	314,247.900	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	12,584.000	495,180.400	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	41,563.000	3,263,526.760	
	VASTNED RETAIL	7,354.000	184,585.400	
	WAREHOUSES DE PAUW	71,186.000	1,862,225.760	
	WERELDHAVE NV	13,999.000	191,506.320	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	14,000.000	416,500.000	
	ユーロ 小計	939,683.000	19,407,822.160 (3,286,326,526)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	23,341.000	81,693,500.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	63,994.000	312,930,660.000	
	JR REIT XXVII	65,671.000	273,191,360.000	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	22,542.000	105,721,980.000	
	LOTTE REIT CO LTD	48,275.000	164,376,375.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	21,573.000	78,525,720.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	27,173.000	171,461,630.000	
	SK REITS CO LTD	48,785.000	233,924,075.000	
	韓国・ウォン 小計	321,354.000	1,421,825,300.000 (162,514,632)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	735,070.000	1,212,865.500	
	LINK REIT	1,052,720.000	35,687,208.000	
	PROSPERITY REIT	538,000.000	742,440.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	368,000.000	662,400.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	908,000.000	917,080.000	
	香港・ドル 小計	3,601,790.000	39,221,993.500 (789,930,949)	
投資証券 合計		28,964,254	76,262,146,576 (76,262,146,576)	
合計			85,575,259,452 (85,575,259,452)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)

アメリカ・ドル	投資信託受益証券	5銘柄	0.06	-	77.27
	投資証券	133銘柄	-	76.51	
イギリス・ポンド	投資証券	36銘柄	-	5.11	5.16
イスラエル・シケル	投資証券	3銘柄	-	0.11	0.11
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	31銘柄	7.65	-	7.72
カナダ・ドル	投資証券	26銘柄	-	1.38	1.40
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	22銘柄	2.98	-	3.01
ニュージーランド・ドル	投資証券	4銘柄	-	0.29	0.29
ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	0.04	-	3.88
	投資証券	26銘柄	-	3.81	
韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	-	0.19	0.19
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.06	-	0.98
	投資証券	5銘柄	-	0.91	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2024年6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,016,372,863
コール・ローン	244,334,771
株式	93,800,415,815
投資信託受益証券	594,946,456
投資証券	83,926,427
派生商品評価勘定	13,173,597
未収入金	821,734
未収配当金	177,035,451
差入委託証拠金	2,003,384,769
流動資産合計	98,934,411,883
資産合計	98,934,411,883
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,309,185
未払解約金	952,000
流動負債合計	39,261,185
負債合計	39,261,185
純資産の部	
元本等	
元本	54,503,344,470
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	44,391,806,228
元本等合計	98,895,150,698
純資産合計	98,895,150,698
負債純資産合計	98,934,411,883

## 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12月12日 至 2024年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	56,111,784,828円
同期中追加設定元本額	12,457,374,037円
同期中一部解約元本額	14,065,814,395円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	10,330,331,529円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>	5,743,106,267円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,329,297円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,586,105円



MITO ラップ型ファンド(積極型)	26,731,936円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,481,250円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,859,393円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	18,017,025円
たわらノーロード 新興国株式	13,773,472,117円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	264,796,199円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,799,123,231円
たわらノーロード バランス(堅実型)	29,475,717円
たわらノーロード バランス(標準型)	134,077,553円
たわらノーロード バランス(積極型)	267,862,332円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	93,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	491,029円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	98,598,069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)	123,125,434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)	220,242,083円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	11,703円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	8,913,113円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,683,442円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	9,835,660円
たわらノーロード 全世界株式	2,537,974,343円
One DC 新興国株式インデックスファンド	1,377,730,360円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	385,770,348円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	348,749,210円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	597,969,327円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,152,822,227円
投資のソムリエ	4,245,741,421円
クルーズコントロール	345,243,410円
投資のソムリエ<DC年金>	450,326,180円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	496,828,167円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	781,160,369円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,396,615,762円
ワールドアセットバランス(基本コース)	445,245,322円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,069,331,835円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	141,920,321円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	73,607,326円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,273,989円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	118,506,008円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	811,404,770円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	290,305,902円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	79,028,056円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	78,745,789円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	48,431,353円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	12,242,410円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	20,256,333円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	67,532,419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)	2,475,038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)	113,670,568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)	77,192,332円
計	54,503,344,470円

2. 受益権の総数

54,503,344,470口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	4,973,510,261

投資信託受益証券	24,478,088
投資証券	9,194,758
合計	4,939,837,415

（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（2024年4月19日から2024年6月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

#### 通貨関連

種類	2024年6月11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	1,091,522	-	1,091,551	29
ブラジル・リアル	1,091,522	-	1,091,551	29
買建	144,709,922	-	145,026,424	316,502
アメリカ・ドル	144,709,922	-	145,026,424	316,502
合計	145,801,444	-	146,117,975	316,473

（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。

#### 株式関連

種類	2024年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引				
買建	4,429,681,215	-	4,404,229,154	25,452,061
合計	4,429,681,215	-	4,404,229,154	25,452,061

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年6月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8145円 (18,145円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年6月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	14,076	17.110	240,840.360	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	5,400	160.260	865,404.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,905	110.320	761,759.600	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	219,522	1.572	345,088.580	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	1.854	165,006.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	51,568	2.145	110,613.360	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC	7,574	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	107,951	0.000	0.000	
	SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000	
	TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000	
	VTB BANK PJSC	304,000,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,573	16.180	494,671.140	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,582	10.870	386,776.340	
	VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000	
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	897,112	0.000	0.000		
YANDEX NV	25,601	0.000	0.000		
PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000		
H WORLD GROUP LTD ADR	16,409	34.800	571,033.200		

	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	20.330	203,300.000	
	NIO INC ADR	108,122	4.720	510,335.840	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	59,863	14.240	852,449.120	
	AUTOHOME INC ADR	4,983	27.260	135,836.580	
	KANZHUN LTD ADR	21,614	21.350	461,458.900	
	KE HOLDINGS INC ADR	52,192	15.920	830,896.640	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,782	45.540	263,312.280	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	PDD HOLDINGS INC ADR	48,325	148.480	7,175,296.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	32,205	34.700	1,117,513.500	
	IQIYI INC ADR	33,439	4.230	141,446.970	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	34,164	23.770	812,078.280	
アメリカ・ドル	小計	307,234,406		16,445,116.690 (2,587,310,209)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	118,172	10.920	1,290,438.240	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	243,692	5.540	1,350,053.680	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	284,657	16.160	4,600,057.120	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	230,790	7.780	1,795,546.200	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	350,911	11.820	4,147,768.020	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	532,492	7.570	4,030,964.440	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	323,840	5.830	1,887,987.200	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	151,332	16.050	2,428,878.600	
	MULTIPLY GROUP	316,386	2.000	632,772.000	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	250,589	3.040	761,790.560	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	268,290	3.440	922,917.600	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	3,071,151		23,849,173.660 (1,023,129,550)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	245,849	2,942.800	723,484,437.200	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	59,189	602.600	35,667,291.400	
	ASIAN PAINTS LTD	30,691	2,937.550	90,156,347.050	
	BANK OF BARODA	74,365	276.400	20,554,486.000	
	EICHER MOTORS LTD	11,149	4,782.750	53,322,879.750	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	21,488	2,446.800	52,576,838.400	
	HDFC BANK LTD	226,901	1,561.300	354,260,531.300	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,480	2,807.550	211,913,874.000	
	SHREE CEMENT LTD	759	27,239.700	20,674,932.300	

ICICI BANK LTD	419,311	1,123.800	471,221,701.800	
INDUSIND BANK LTD	21,721	1,485.850	32,274,147.850	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	42,590	521.950	22,229,850.500	
STATE BANK OF INDIA LTD	144,138	831.800	119,893,988.400	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	19,695	1,054.950	20,777,240.250	
TATA STEEL LTD	609,848	180.290	109,949,495.920	
TATA MOTORS LTD	136,135	975.150	132,752,045.250	
JSW STEEL LTD	47,396	915.900	43,409,996.400	
TATA COMMUNICATIONS LTD	8,325	1,859.000	15,476,175.000	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,653	1,133.050	51,727,131.650	
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,047	8,423.400	17,242,699.800	
TATA POWER CO LTD	116,480	448.000	52,183,040.000	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,690	5,488.400	47,694,196.000	
NESTLE INDIA LTD	27,443	2,548.200	69,930,252.600	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	82,126	284.450	23,360,740.700	
GAIL INDIA LTD	176,391	208.180	36,721,078.380	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	88,970	1,745.650	155,310,480.500	
VEDANTA LTD	90,404	444.100	40,148,416.400	
SUPREME INDUSTRIES LTD	5,257	5,999.400	31,538,845.800	
AXIS BANK LTD	184,556	1,200.000	221,467,200.000	
TITAN COMPANY LTD	28,558	3,422.200	97,731,187.600	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	253,743	259.150	65,757,498.450	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,612	2,944.200	34,188,050.400	
BHARAT ELECTRONICS LTD	294,208	283.400	83,378,547.200	
LUPIN LTD	17,611	1,634.150	28,779,015.650	
NMDC LTD	81,582	254.700	20,778,935.400	
MPHASIS LTD	6,550	2,394.600	15,684,630.000	
BAJAJ FINANCE LTD	22,600	7,088.850	160,208,010.000	
INFOSYS LTD	268,642	1,499.750	402,895,839.500	
WIPRO LTD	105,400	475.250	50,091,350.000	
TATA ELXSI LTD	2,960	7,140.150	21,134,844.000	
MRF LTD	175	126,963.300	22,218,577.500	
INDIAN OIL CORP LTD	231,980	165.210	38,325,415.800	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	66,717	2,565.350	171,152,455.950	
TRENT LTD	14,859	4,969.450	73,841,057.550	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,212	6,056.700	49,737,620.400	
CUMMINS INDIA LTD	11,753	3,544.050	41,653,219.650	
HCL TECHNOLOGIES LTD	75,976	1,418.750	107,790,950.000	
DABUR INDIA LTD	46,381	619.850	28,749,262.850	
HERO MOTOCORP LTD	9,704	5,722.200	55,528,228.800	
SRF LTD	11,493	2,354.650	27,061,992.450	

BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,405	3,250.550	20,819,772.750	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,588	6,106.150	58,545,766.200	
BHARTI AIRTEL LTD	183,172	1,426.050	261,212,430.600	
PUNJAB NATIONAL BANK LTD	175,051	125.340	21,940,892.340	
UNITED SPIRITS LTD	22,698	1,315.100	29,850,139.800	
UNION BANK OF INDIA LTD	119,319	147.220	17,566,143.180	
CANARA BANK	149,548	121.030	18,099,794.440	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	77,006	1,513.100	116,517,778.600	
DIVI'S LABORATORIES LTD	10,063	4,536.250	45,648,283.750	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,365	12,717.550	144,534,955.750	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,722	1,249.200	27,135,122.400	
HAVELLS INDIA LTD	19,728	1,856.850	36,631,936.800	
TVS MOTOR COMPANY LTD	19,342	2,436.850	47,133,552.700	
JINDAL STEEL & POWER LTD	27,284	1,012.150	27,615,500.600	
JINDAL STAINLESS LTD	27,489	813.900	22,373,297.100	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	218,936	164.580	36,032,486.880	
SHRIRAM FINANCE LTD	22,941	2,519.100	57,790,673.100	
PETRONET LNG LTD	61,507	302.750	18,621,244.250	
CIPLA LTD/INDIA	42,866	1,534.250	65,767,160.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	54,568	3,543.750	193,375,350.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,165	10,826.250	99,222,581.250	
ASHOK LEYLAND LTD	121,319	231.420	28,075,642.980	
BOSCH LTD	592	30,764.750	18,212,732.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	73,032	3,858.700	281,808,578.400	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,628	3,220.100	43,883,522.800	
NTPC LTD	350,103	364.900	127,752,584.700	
YES BANK LTD	1,178,292	23.870	28,125,830.040	
AMBUJA CEMENTS LTD	48,912	640.350	31,320,799.200	
BHARAT FORGE LTD	21,319	1,580.800	33,701,075.200	
SUZLON ENERGY LTD	778,252	47.400	36,889,144.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	108,877	676.400	73,644,402.800	
ITC LTD	243,422	436.900	106,351,071.800	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,991	3,174.050	38,060,033.550	
UNITED PHOSPHORUS LTD	38,855	551.500	21,428,532.500	
SUNDARAM FINANCE LTD	5,486	4,621.050	25,351,080.300	
PHOENIX MILLS LTD	8,172	3,328.600	27,201,319.200	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,201	2,863.950	23,487,253.950	
THERMAX LTD	3,487	5,161.750	17,999,022.250	
SIEMENS INDIA LTD	7,243	6,856.550	49,661,991.650	
INFO EDGE INDIA LTD	6,037	6,226.950	37,592,097.150	
GMR INFRASTRUCTURE LTD	191,362	86.930	16,635,098.660	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	50,227	654.750	32,886,128.250	

GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33,447	1,423.050	47,596,753.350	
TECH MAHINDRA LTD	44,064	1,340.350	59,061,182.400	
INDIAN HOTELS CO LTD	70,981	582.300	41,332,236.300	
TORRENT POWER LTD	13,970	1,531.500	21,395,055.000	
MARICO LTD	39,330	651.650	25,629,394.500	
POWER FINANCE CORP LTD	120,494	485.800	58,535,985.200	
PAGE INDUSTRIES LTD	508	38,652.750	19,635,597.000	
ABB LTD/INDIA	4,375	8,061.950	35,271,031.250	
DLF LTD	58,079	847.600	49,227,760.400	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	373,975	315.800	118,101,305.000	
NHPC LTD	249,136	101.980	25,406,889.280	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	7,778	3,745.500	29,132,499.000	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,728	1,384.050	59,137,688.400	
REC LTD	107,503	511.200	54,955,533.600	
BAJAJ FINSERV LTD	29,864	1,565.800	46,761,051.200	
BAJAJ AUTO LTD	5,635	9,733.050	54,845,736.750	
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	523.000	15,829,118.000	
ADANI POWER LTD	63,076	769.700	48,549,597.200	
MUTHOOT FINANCE LTD	9,935	1,759.400	17,479,639.000	
JSW ENERGY LTD	28,936	629.650	18,219,552.400	
COAL INDIA LTD	125,313	477.700	59,862,020.100	
TATA MOTORS LTD	33,523	654.650	21,945,831.950	
INDUS TOWERS LTD	66,139	348.150	23,026,292.850	
PI INDUSTRIES LTD	6,463	3,640.500	23,528,551.500	
VARUN BEVERAGES LTD	36,645	1,546.050	56,655,002.250	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,731	3,959.550	34,570,831.050	
LTIMINDTREE LTD	7,301	4,903.450	35,800,088.450	
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,426	1,880.350	47,809,779.100	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	78,639	569.200	44,761,318.800	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,495	669.450	20,414,877.750	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	16,100	4,812.700	77,484,470.000	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,421	3,790.800	28,131,526.800	
BANDHAN BANK LTD	72,375	198.320	14,353,410.000	
GODREJ PROPERTIES LTD	9,790	2,845.400	27,856,466.000	
POLYCAB INDIA LTD	4,354	6,798.900	29,602,410.600	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	33,361	1,359.950	45,369,291.950	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	22,115	717.100	15,858,666.500	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	18,362	977.900	17,956,199.800	



	ZOMATO LTD	537,478	182.160	97,906,992.480	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	24,489	1,474.900	36,118,826.100	
	MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	64,064	811.750	52,003,952.000	
	APL APOLLO TUBES LTD	12,592	1,629.800	20,522,441.600	
	SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	32,684	660.200	21,577,976.800	
	PB FINTECH LTD	24,230	1,293.750	31,347,562.500	
	MANKIND PHARMA LTD	8,411	2,173.550	18,281,729.050	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	228,797	350.350	80,159,028.950	
	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	10,569	2,160.750	22,836,966.750	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	12,852	4,778.400	61,411,996.800	
	IDFC BANK LTD	288,299	77.530	22,351,821.470	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	18,897	1,680.100	31,748,849.700	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	30,106	581.000	17,491,586.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	14,217	4,566.600	64,923,352.200	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	2,247	9,331.300	20,967,431.100	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	35,181	1,432.300	50,389,746.300	
インド・ルピー	小計	12,434,081		9,462,240,735.400 (17,883,634,990)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	547,000	1,240.000	678,280,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,178,385	1,035.000	2,254,628,475.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	112,201	22,325.000	2,504,887,325.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	6,175.000	2,247,700,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	3,070.000	1,816,212,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,654,200	4,510.000	7,460,442,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,947,700	3,010.000	11,882,577,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	620,600	5,200.000	3,227,120,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	192,100	9,125.000	1,752,912,500.000	
	BANK MANDIRI	3,023,800	6,275.000	18,974,345,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,522,400	4,400.000	24,298,560,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,203,900	4,610.000	5,549,979,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,953,000	1,595.000	3,115,035,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,463,000	9,525.000	42,510,075,000.000	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	633,400	8,675.000	5,494,745,000.000	

	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,308,000	2,750.000	3,597,000,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	10,500.000	2,038,050,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,482,800	2,800.000	4,151,840,000.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	74,896,200	56.000	4,194,187,200.000	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL PT	528,400	11,950.000	6,314,380,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	794,082	2,460.000	1,953,441,720.000	
	インドネシア・ルピア 小計	106,210,868		156,016,397,220.000 (1,513,359,053)	
オフショア・人 民元	EVE ENERGY CO LTD	14,732	41.290	608,284.280	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	72.950	423,110.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	32.750	194,535.000	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	44.940	134,820.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	15,000	13.290	199,350.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	8.190	98,280.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	32.240	167,003.200	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	14.950	182,390.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	17.540	306,950.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	18,640	22.920	427,228.800	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	15.090	288,219.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	57.050	68,460.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	14.610	236,682.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	2,200	29.160	64,152.000	
	CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD	2,100	103.690	217,749.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	23.510	277,418.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	22.310	180,711.000	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	15.110	210,029.000	
	YINTAI GOLD CO LTD	23,900	18.550	443,345.000	

GEM CO LTD	29,100	6.530	190,023.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	53.610	139,386.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	12.320	85,008.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	3.670	213,227.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	22.560	381,264.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	5,900	97.620	575,958.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	6.350	99,015.550	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	23.570	139,157.280	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	18.780	109,149.360	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	17.790	237,674.400	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	32.090	163,659.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	49.240	457,932.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	19.280	200,512.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	39.800	39,800.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	47.870	1,148,880.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	8,950	30.650	274,317.500	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	11.100	199,800.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	9.290	167,220.000	
TIANQI LITHIUM CORP	4,300	34.000	146,200.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	8.890	99,568.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	9.710	240,808.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	14.780	208,398.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	31.890	382,680.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	17.790	138,762.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	9.810	505,705.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	64.650	387,900.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	55.770	124,869.030	

INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	35.280	404,661.600	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.620	134,874.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.640	133,588.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	11.790	468,404.910	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	29.550	319,140.000	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	500	27.260	13,630.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	16.090	111,021.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	33,100	7.460	246,926.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	69.790	341,971.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	10.590	162,027.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	31.370	194,494.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	34.000	170,000.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	70,900	3.790	268,711.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	13.760	218,784.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	20.500	200,900.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,600	166.180	1,262,968.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	54.370	260,976.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	10.020	137,023.500	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	9.850	86,089.000	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	33.010	300,391.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	111.930	402,948.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	7.380	269,222.400	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	8.980	128,414.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	31,154	32.200	1,003,158.800	

QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	17.180	513,682.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.510	464,163.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	9.720	193,428.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	16.150	308,465.000	
IFLYTEK CO LTD	7,900	41.510	327,929.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.080	194,272.000	
GOERTEK INC	25,100	16.950	425,445.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.290	133,977.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	23.680	833,536.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	30,200	15.640	472,328.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	54,420	4.470	243,257.400	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.200	147,160.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	13.310	538,895.280	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.500	147,550.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	24.890	306,147.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	54.110	569,237.200	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	12.160	947,482.880	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY CO LTD	7,800	91.220	711,516.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,600	142.340	2,647,524.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	58,900	7.430	437,627.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	137,400	4.140	568,836.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	9.990	458,541.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	41.100	497,310.000	
MIDEA GROUP CO LTD	16,200	65.160	1,055,592.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.280	392,544.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	10.990	1,068,228.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	24,480	21.560	527,788.800	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	113,500	4.490	509,615.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	8.170	450,167.000	
ZTE CORP	16,500	26.790	442,035.000	

ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	8.110	231,135.000	
WEICHAI POWER CO LTD	44,200	16.070	710,294.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	39.410	165,522.000	
GF SECURITIES CO LTD	15,300	12.470	190,791.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	7.620	160,782.000	
BYD CO LTD	8,400	235.500	1,978,200.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	4.750	161,975.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	18.800	181,608.000	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	30.460	159,001.200	
LB GROUP CO LTD	11,000	21.160	232,760.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	8.440	361,232.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	14.500	169,650.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	16.410	208,407.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,200	318.390	700,458.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	7.520	226,352.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	24.280	310,784.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	7.530	257,526.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	243.440	413,848.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.050	109,980.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	31.220	206,052.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	52.460	31,476.000	
NINESTAR CORP	10,400	26.360	274,144.000	
HISENSE HOME APPLIANCES GROUP CO LTD	5,700	38.850	221,445.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	5.560	212,392.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	8.620	219,120.400	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	22.970	388,193.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	74.110	134,880.200	
SF HOLDING CO LTD	24,400	37.860	923,784.000	

FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.230	123,428.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	57.800	144,500.000	
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD	3,900	91.120	355,368.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	80,290	7.750	622,247.500	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	7.820	304,198.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	82,800	5.250	434,700.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	49.700	114,310.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	28,900	20.690	597,941.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	16.540	106,864.940	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	14.210	352,408.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	43.500	134,850.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.740	241,650.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46	19.410	892.860	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	5.270	204,476.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	18.050	275,767.900	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	91.300	200,860.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	35.930	158,451.300	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	36.900	136,530.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	31.030	83,781.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	64.850	136,185.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	26.430	240,935.880	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	13.270	126,065.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	4,340	119.510	518,673.400	
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY NETWORK & TECHNOLOGY HOLDINGS CO LTD	27,500	11.990	329,725.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	59.570	5,957.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	24.520	169,188.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	3,340	93.830	313,392.200	

HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	99.390	298,170.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	25.220	121,056.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	25.420	78,802.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	17.440	55,808.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	6.920	87,884.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	49.150	117,960.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	15.470	329,511.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	140	37.090	5,192.600	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	31.030	58,957.000	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	23.150	273,170.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	57,600	24.530	1,412,928.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	299.770	1,738,666.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	53.030	84,848.000	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	4,050	47.330	191,686.500	
SG MICRO CORP	3,395	81.420	276,420.900	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	21,540	193.200	4,161,528.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	83.460	251,715.360	
WUXI APPTec CO LTD	13,972	42.390	592,273.080	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	51,400	6.920	355,688.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	23.380	240,814.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,400	5.030	117,702.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	3.390	279,675.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	29.090	212,357.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	85.520	218,931.200	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	25,300	16.370	414,161.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	19.550	145,158.750	



SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,540	196.120	302,024.800	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	54.700	60,170.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	41.040	103,420.800	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	142.250	426,750.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	50.600	273,240.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	5.970	318,798.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	28,700	10.530	302,211.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	100.140	503,704.200	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.930	334,899.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	2.760	195,132.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	30.740	328,918.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	6.980	173,104.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	47.010	136,329.000	
CGN POWER CO LTD	69,500	4.410	306,495.000	
CITIC PACIFIC SPECIAL STEEL GROUP CO LTD	21,200	14.950	316,940.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	199,300	5.240	1,044,332.000	
GONEO GROUP CO LTD	2,755	82.010	225,937.550	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	55.810	178,592.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,120	88.130	98,705.600	
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD	2,800	86.820	243,096.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	138.080	212,090.880	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	5,520	30.340	167,476.800	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	5.050	593,880.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	9.440	198,240.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	37.550	120,160.000	

JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	1,350	36.000	48,600.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	8.190	356,265.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	52.300	73,220.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	29.640	180,804.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	43.580	124,638.800	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	13.990	161,892.280	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.000	213,600.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	6,577	66.580	437,896.660	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	73.760	213,904.000	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	5,320	10.430	55,487.600	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	84.830	220,558.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,900	30.960	244,584.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	47.430	218,178.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	4,000	121.350	485,400.000	
PIOTECH INC	592	204.100	120,827.200	
RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,100	26.600	242,060.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	8.430	338,886.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	181.000	506,800.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	30.150	122,409.000	
ANKER INNOVATIONS TECHNOLOGY CO LTD	3,400	70.950	241,230.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,540	200.020	308,030.800	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	4,480	85.910	384,876.800	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	258.570	632,720.790	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	13.830	262,770.000	

BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	840	412.450	346,458.000	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	24.680	212,248.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.160	400,896.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	16,800	15.410	258,888.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	9.990	1,171,827.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	5.520	1,687,464.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	4.260	1,759,806.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	4.530	887,880.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	160,800	6.290	1,011,432.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	30.990	427,662.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	44.150	1,496,685.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	93,700	33.990	3,184,863.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	51,800	42.120	2,181,816.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	99,900	17.530	1,751,247.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	166,700	8.310	1,385,277.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	133,400	3.850	513,590.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.110	599,675.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,000	1,619.180	9,715,080.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	194,300	7.360	1,430,048.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	18.380	1,097,286.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,200	28.310	1,138,062.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.860	224,438.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	110,600	28.310	3,131,086.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.230	597,198.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	3.210	739,263.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	168,300	5.610	944,163.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	8.080	448,440.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	6.790	480,053.000	

INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	27.060	800,976.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	138,300	5.770	797,991.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	124,800	4.570	570,336.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	117,500	6.990	821,325.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	24.300	563,760.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	14.160	584,808.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	9.400	554,600.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	25.010	292,617.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	10.420	580,394.000	
CRRC CORP LTD	108,900	7.200	784,080.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	32,652	42.150	1,376,281.800	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	18.190	316,506.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	12.980	523,094.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	6.680	571,808.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	31.860	210,276.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	30.620	786,934.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	45,600	16.170	737,352.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	5.960	603,748.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	7.200	404,640.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	23.970	297,228.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	7.860	207,504.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	38,100	12.180	464,058.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	14,500	87.990	1,275,855.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	3.880	305,356.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION CO LTD	81,400	3.170	258,038.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	17.760	1,838,160.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	8.070	444,657.000	

SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	18.380	702,116.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	23.770	991,494.240	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	6.090	181,482.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	72.600	711,480.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	8.670	267,903.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.460	324,850.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	79.500	349,800.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	2.410	60,250.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	76,300	7.920	604,296.000	
AIR CHINA LTD	44,800	7.450	333,760.000	
TBEA CO LTD	24,180	14.390	347,950.200	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	8.490	369,315.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.210	180,402.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	5.340	556,428.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	38.480	815,776.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,600	34.200	396,720.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	31.790	219,351.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	24.890	370,861.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.710	127,253.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	16.160	93,728.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	7.900	199,080.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	8.860	292,380.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	18.680	442,716.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	18.780	214,092.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	37.550	349,215.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.120	579,876.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	20,450	5.360	109,612.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	72,870	17.180	1,251,906.600	

CMOC GROUP LIMITED	79,800	8.410	671,118.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	31,700	14.710	466,307.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	5.210	176,098.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	44.040	396,360.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	28.850	580,462.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	20.570	160,446.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	11.170	309,409.000	
PEOPLE.CN CO LTD	7,000	21.160	148,120.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.290	346,107.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	21,000	23.870	501,270.000	
YUTONG BUS CO LTD	6,000	25.230	151,380.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	9.160	392,964.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	3.960	314,820.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	18.520	278,151.880	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	7.240	419,920.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	16,400	22.230	364,572.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	19.390	199,018.960	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	10.770	175,012.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	18.270	60,291.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	5.870	264,737.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.280	134,520.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	47.450	483,990.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.360	176,904.000	
YOUNGOR FASHION CO LTD	25,600	7.930	203,008.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	41.450	190,670.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.370	107,016.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	800	19.000	15,200.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	14,200	8.420	119,564.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	10.990	245,626.500	

INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	3.990	157,206.000	
HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD	9,300	28.500	265,050.000	
WESTERN MINING CO LTD	15,100	18.380	277,538.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	226.280	565,700.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	8.040	274,164.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,080	237.430	1,443,574.400	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	9.300	528,240.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	5.730	143,250.000	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD	16,400	21.220	348,008.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	1,250	29.400	36,750.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	23.050	467,915.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	3.820	111,544.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	2,700	31.190	84,213.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	14.460	182,196.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	15,900	18.400	292,560.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	26.720	112,224.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.330	230,356.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	8.190	388,697.400	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	21.240	269,748.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	17.300	100,859.000	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	10.230	199,485.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.350	145,730.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	12.410	277,984.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	15,400	19.900	306,460.000	

SHANXI COAL INTERNATIONAL ENERGY GROUP CO LTD	11,100	15.930	176,823.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	21.780	370,260.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	10,654	41.280	439,797.120	
JCET GROUP CO LTD	10,900	27.750	302,475.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	17.500	119,000.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	70.900	177,250.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	27.260	144,478.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	28.250	296,342.500	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	85.040	144,568.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	11.620	235,258.520	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	1.870	116,688.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	9.450	124,740.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,924	51.530	202,203.720	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	14.380	281,848.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	14.310	281,907.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	14.710	230,947.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	2,210	59.200	130,832.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	30.100	147,490.000	
NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD	9,004	34.170	307,666.680	
SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	70.460	147,966.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	2,100	33.760	70,896.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	52.210	46,989.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	2,156	66.070	142,446.920	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	1,000	225.740	225,740.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	56.300	90,080.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	37.010	262,771.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	20.340	225,774.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.680	710,424.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	25.660	297,656.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	52,200	7.150	373,230.000	



SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	7,760	43.220	335,387.200	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	12,200	68.140	831,308.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	44,968	16.740	752,764.320	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	18.080	229,616.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	126.500	227,700.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	6.900	505,770.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	700	38.860	27,202.000	
HEILAN HOME CO LTD	44,100	9.110	401,751.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	40,151	26.710	1,072,433.210	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	25,519	35.460	904,903.740	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	4,400	51.720	227,568.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.210	108,372.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	57.040	399,280.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	1,000	12.270	12,270.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	13.780	560,846.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	10.400	1,092,000.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	40.860	138,924.000	
SERES GROUP CO LTD	9,000	86.670	780,030.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	64.790	343,387.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.920	658,944.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	33,900	13.210	447,819.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	19.870	226,518.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	47.980	67,172.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	21,200	16.160	342,592.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	950	35.030	33,278.500	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	11.340	344,736.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	5.970	252,531.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	20.520	377,568.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,012	24.560	98,534.720	

	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,804	35.000	168,140.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	60.880	178,987.200	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	21.790	246,444.900	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	15,900	7.960	126,564.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	57.670	380,622.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.500	248,000.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	35.050	157,725.000	
オフショア・人民元 小計		13,111,217		180,050,736.130 (3,896,153,889)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	364,684	13.870	5,058,167.080	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	268,621	3.940	1,058,366.740	
	OOREDOO QSC	60,920	9.774	595,432.080	
	QATAR FUEL QSC	46,222	14.820	685,010.040	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,416	15.050	563,110.800	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	83,628	10.040	839,625.120	
	INDUSTRIES QATAR QSC	123,793	12.050	1,491,705.650	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	145,929	17.700	2,582,943.300	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	239,235	4.413	1,055,744.050	
	MASRAF AL RAYAN	479,150	2.342	1,122,169.300	
	BARWA REAL ESTATE CO	190,141	2.899	551,218.750	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	429,105	1.740	746,642.700	
	DUKHAN BANK	131,518	3.559	468,072.560	
カタール・リアル 小計		2,600,362		16,818,208.170 (727,051,139)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	836,149	0.724	605,371.870	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	152,316	0.450	68,542.200	
	GULF BANK KSCP	154,340	0.265	40,900.100	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	647,282	0.858	555,367.950	
	MABANEE CO KPSC	49,098	0.861	42,273.370	
	BOUBYAN BANK KSCP	113,874	0.582	66,274.660	
クウェート・ディナール 小計		1,953,059		1,378,730.150 (708,405,338)	

コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	31,105	18,680.000	581,041,400.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	36,200.000	725,773,800.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	39,539	35,080.000	1,387,028,120.000	
コロンビア・ペソ 小計		90,693		2,693,843,320.000 (106,934,804)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	21,587	37.100	800,877.700	
	JARIR MARKETING CO	45,430	13.300	604,219.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	5,690	144.000	819,360.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	31,195	50.800	1,584,706.000	
	SAUDI BRITISH BANK	80,349	39.050	3,137,628.450	
	AL RAJHI BANK	158,927	80.900	12,857,194.300	
	ARAB NATIONAL BANK	74,025	21.000	1,554,525.000	
	BANK ALBILAD	48,216	34.200	1,648,987.200	
	BANK AL-JAZIRA	37,396	16.940	633,488.240	
	BANQUE SAUDI FRANSI	47,579	36.200	1,722,359.800	
	RIYAD BANK	120,931	25.700	3,107,926.700	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	56,260	13.320	749,383.200	
	SAUDI TELECOM CO	162,904	37.650	6,133,335.600	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,317	110.800	2,029,523.600	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	73,284	76.200	5,584,240.800	
	SAUDI ELECTRICITY CO	70,794	16.920	1,197,834.480	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	21.440	597,039.680	
	SAVOLA GROUP	20,951	44.450	931,271.950	
	ALMARAI CO JSC	19,978	56.700	1,132,752.600	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,121	217.000	677,257.000	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	30,296	30.650	928,572.400	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	39.050	396,904.200	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,476	8.290	501,346.040	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	38,509	12.360	475,971.240	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	11.800	425,496.200	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,510	239.200	1,557,192.000	
ALINMA BANK	100,733	32.700	3,293,969.100		
SAUDI ARABIAN MINING CO	105,148	45.300	4,763,204.400		
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,975	121.400	968,165.000		
DALLAH HEALTHCARE CO	2,553	167.000	426,351.000		

	SAUDI ARABIAN OIL CO	215,673	28.350	6,114,329.550	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	6,966	308.800	2,151,100.800	
	ACWA POWER CO	11,887	376.000	4,469,512.000	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	136.800	544,600.800	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	1,686	299.600	505,125.600	
	NAHDI MEDICAL CO	3,277	134.200	439,773.400	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,500	252.400	883,400.000	
	ELM CO	1,959	848.800	1,662,799.200	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	60.000	398,100.000	
	ADES HOLDING CO	26,333	20.240	532,979.920	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	2,057	289.200	594,884.400	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	238,281	35.700	8,506,631.700	
	サウジアラビア・リアル 小計	2,045,439		88,044,320.250 (3,699,622,337)	
タイ・パーツ	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	17.700	5,363,100.000	
	CP AXTRA PCL NVDR	159,300	28.250	4,500,225.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	127.500	5,788,500.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL- NVDR	1,667,200	1.680	2,800,896.000	
	SHIN CORP PCL	70,700	72.500	5,125,750.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	22.400	6,720,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	94,100	209.000	19,666,900.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	516,920	9.300	4,807,356.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	250,000	74.250	18,562,500.000	
	PTT PCL	783,400	32.250	25,264,650.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	45.000	3,622,500.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	65,050	232.000	15,091,600.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	347,800	60.750	21,128,850.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	156,500	56.500	8,842,250.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	911,100	26.750	24,371,925.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	51,300	239.000	12,260,700.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	274,010	30.000	8,220,300.000	
	THAI OIL PCL NVDR	89,000	50.250	4,472,250.000	
	CP ALL PCL NVDR	480,400	57.500	27,623,000.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	110,445	152.000	16,787,640.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	135,122	20.500	2,770,001.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	183,408	32.250	5,914,908.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	138,000	20.000	2,760,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	7.850	4,944,715.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	253,500	40.000	10,140,000.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	527,100	3.540	1,865,934.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	158,333	30.750	4,868,739.750	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	97,800	33.500	3,276,300.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	208,600	16.900	3,525,340.000	
	SCB X PCL NVDR	67,700	104.000	7,040,800.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	896,328	8.350	7,484,338.800	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	68,800	43.250	2,975,600.000	
	タイ・パーツ 小計	10,120,716		298,587,568.550 (1,277,954,793)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	770.000	4,528,370.000	
	CEZ	13,485	949.500	12,804,007.500	
	MONETA MONEY BANK AS	23,959	98.500	2,359,961.500	
チェコ・コルナ	小計	43,325		19,692,339.000 (135,376,954)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	43.200	228,087,705.600	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	7,027	26,300.000	184,810,100.000	
	BANCO DE CHILE	3,896,607	107.200	417,716,270.400	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,900.000	161,313,800.000	
	EMPRESAS COPEC SA	29,969	7,500.200	224,773,493.800	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,173,923	60.500	71,022,341.500	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	89.400	150,501,413.400	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,823,587	13.000	179,706,631.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	11,501	42,175.000	485,054,675.000	
	FALABELLA SA	63,470	2,860.000	181,524,200.000	
	CENCOSUD SA	116,272	1,799.000	209,173,328.000	
	ENEL CHILE SA	1,930,415	53.480	103,238,594.200	
チリ・ペソ	小計	28,100,942		2,596,922,552.900 (443,528,403)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	260,091	59.450	15,462,409.950	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	108,854	58.300	6,346,188.200	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	107,671	46.440	5,000,241.240	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	1,019.000	5,799,129.000	
	KOC HOLDING AS	59,863	209.400	12,535,312.200	
	SASA POLYESTER SANAYI	105,230	43.900	4,619,597.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	109,000	47.280	5,153,520.000	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	9,553	293.500	2,803,805.500	
	TURK HAVA YOLLARI	44,686	299.750	13,394,628.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	105,442	99.000	10,438,758.000	
	TURKIYE IS BANKASI	657,193	15.290	10,048,480.970	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	79,870	162.300	12,962,901.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	281,190	31.740	8,924,970.600	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	82,771	89.650	7,420,420.150	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,340	785.000	4,976,900.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	36,989	486.000	17,976,654.000	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	16,769	198.400	3,326,969.600	
トルコ・リラ 小計		2,077,203		147,190,885.910 (715,524,335)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	11,886	9,375.000	111,431,250.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	32,609	2,836.000	92,479,124.000	
	OTP BANK NYRT	18,316	17,700.000	324,193,200.000	
ハンガリー・フォロント 小計		62,811		528,103,574.000 (227,573,033)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	496,800	27.150	13,488,120.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	144,448	119.000	17,189,312.000	
	AYALA CORP	21,463	588.500	12,630,975.500	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	79,760	350.000	27,916,000.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	204,960	29.850	6,118,056.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	34,240	228.600	7,827,264.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	153,485	68.000	10,436,980.000	
	BDO UNIBANK INC	189,682	136.000	25,796,752.000	
	PLDT INC	5,690	1,445.000	8,222,050.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	843,375	27.350	23,066,306.250	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	109.000	8,224,050.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	847.000	16,417,401.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	360.000	8,791,200.000	
フィリピン・ペソ 小計		2,293,156		186,124,466.750	

(498,050,461)

ブラジル・リアル	BRF SA	49,200	18.390	904,788.000	
	VALE SA	275,289	61.070	16,811,899.230	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	83,500	9.190	767,365.000	
	RAIA DROGASIL SA	102,064	25.100	2,561,806.400	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	40.050	819,022.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	96,400	35.980	3,468,472.000	
	BANCO DO BRASIL SA	136,600	27.210	3,716,886.000	
	ITAUSA SA	440,107	9.620	4,233,829.340	
	GERDAU SA	111,337	16.850	1,876,028.450	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	302,010	39.300	11,868,993.000	
	VIBRA ENERGIA SA	84,500	21.300	1,799,850.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	384,212	37.500	14,407,950.000	
	CCR SA	79,920	11.730	937,461.600	
	WEG SA	133,344	37.810	5,041,736.640	
	BANCO BRADESCO SA PRAF	427,902	12.860	5,502,819.720	
	BANCO BRADESCO SA	126,592	11.490	1,454,542.080	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	12.350	595,344.100	
	SUZANO SA	62,775	49.690	3,119,289.750	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	32.850	555,165.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	391,547	31.200	12,216,266.400	
	ENGIE BRASIL SA	15,287	43.480	664,678.760	
	LOCALIZA RENT A CAR	77,089	41.860	3,226,945.540	
	LOJAS RENNER SA	84,020	12.760	1,072,095.200	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	62,004	22.510	1,395,710.040	
	COSAN SA	108,400	12.740	1,381,016.000	
	TOTVS SA	43,300	28.540	1,235,782.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	82,600	29.180	2,410,268.000	
	JBS SA	63,800	29.250	1,866,150.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	142,040	10.150	1,441,706.000	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,498	75.100	2,065,099.800	
	ENEVA SA	44,000	12.460	548,240.000	
	HYPERA SA	29,800	28.800	858,240.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	450,048	10.490	4,721,003.520		
PRIO SA	66,200	40.800	2,700,960.000		
TELEFONICA BRASIL SA	35,328	44.370	1,567,503.360		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	57,900	32.620	1,888,698.000		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	404,761	3.850	1,558,329.850		

	ATACADA O DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	54,800	9.460	518,408.000	
	AMBEV SA	373,395	11.460	4,279,106.700	
	NATURA &CO HOLDING SA	68,800	14.850	1,021,680.000	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A	52,100	14.200	739,820.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	108,900	11.930	1,299,177.000	
	TIM SA	61,300	15.900	974,670.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	46,300	26.550	1,229,265.000	
	RUMO SA	104,500	19.600	2,048,200.000	
	ブラジル・リアル 小計	6,037,025		135,372,267.980 (3,975,463,857)	
ポーランド・ズ ロチ	MBANK	1,196	602.200	720,231.200	
	BUDIMEX SA	1,092	687.000	750,204.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,446	144.250	1,651,085.500	
	BANK PEKAO SA	15,205	155.450	2,363,617.250	
	ORLEN SA	47,436	63.300	3,002,698.800	
	LPP SA	91	17,400.000	1,583,400.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,835	492.900	1,397,371.500	
	CD PROJEKT RED SA	4,671	134.000	625,914.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	69,657	56.540	3,938,406.780	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	80,249	6.814	546,816.680	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	47,901	48.320	2,314,576.320	
	DINO POLSKA SA	3,914	396.000	1,549,944.000	
	ALLEGRO.EU SA	47,943	37.490	1,797,383.070	
	ポーランド・ズロチ 小計	333,636		22,241,649.100 (870,727,200)	
マレーシア・リ ンギット	AMMB HOLDINGS BHD	201,900	4.250	858,075.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	566,200	6.940	3,929,428.000	
	CELCOMDIGI BHD	272,700	3.840	1,047,168.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	82,820	10.040	831,512.800	
	RHB BANK BHD	103,780	5.530	573,903.400	
	GAMUDA BHD	156,100	6.120	955,332.000	
	GENTING BHD	164,900	4.680	771,732.000	
	YTL CORP BHD	263,000	3.600	946,800.000	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	19.400	950,755.200	
	IOI CORP BHD	206,713	3.860	797,912.180	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,900	20.860	915,754.000	
	MALAYAN BANKING BHD	426,075	9.990	4,256,489.250	
	MISC BHD	102,180	8.580	876,704.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,000	126.300	757,800.000	



	PPB GROUP BHD	50,260	14.680	737,816.800	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	18.100	414,490.000	
	PETRONAS GAS BHD	61,000	18.380	1,121,180.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.620	629,062.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	6.290	599,437.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	213,750	13.720	2,932,650.000	
	QL RESOURCES BHD	87,050	6.420	558,861.000	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,185,250	4.110	4,871,377.500	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	193,300	5.060	978,098.000	
	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.750	644,600.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	264,700	2.820	746,454.000	
	MAXIS BHD	175,800	3.640	639,912.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	3.470	769,993.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	217,400	6.710	1,458,754.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	190,200	6.250	1,188,750.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	284,100	5.750	1,633,575.000	
	SD GUTHRIE BHD	161,500	4.310	696,065.000	
	MR DIY GROUP M BHD	245,100	1.930	473,043.000	
	マレーシア・リンギット 小計	6,789,286		39,563,484.530 (1,317,689,547)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	262,900	10.720	2,818,288.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	105,200	70.700	7,437,640.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,115	334.620	5,392,401.300	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	15,860	176.260	2,795,483.600	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	47,400	139.130	6,594,762.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	206,800	138.610	28,664,548.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	87,025	26.630	2,317,475.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,495	236.560	3,665,497.200	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	33.750	4,104,000.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	13,950	566.970	7,909,231.500	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	250,652	95.900	24,037,526.800	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	153,200	43.100	6,602,920.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	39,700	176.970	7,025,709.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	419,200	62.400	26,158,080.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	32,725	301.390	9,862,987.750	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	22,800	167.000	3,807,600.000	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	17.240	1,792,960.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,481,678	15.530	23,010,459.340	
	BANCO DEL BAJIO SA	67,400	52.110	3,512,214.000	
メキシコ・ペソ	小計	3,463,700		177,509,784.240 (1,518,400,943)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	81,745	3.825	312,674.620	
	ALPHA BANK A.E.	185,591	1.623	301,214.190	
	NATIONAL BANK OF GREECE	60,562	8.330	504,481.460	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,676	13.810	230,295.560	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	220,148	2.164	476,400.270	
	MYTILINEOS HOLDINGS	8,906	36.540	325,425.240	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,506	25.700	141,504.200	
	OPAP SA	13,744	14.920	205,060.480	
	JUMBO SA	9,605	27.000	259,335.000	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	11.100	187,312.500	
ユーロ	小計	622,488		2,943,703.520 (498,457,317)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	169,700.000	291,884,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	158,600.000	464,380,800.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,524	337,500.000	851,850,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,655	106,800.000	390,354,000.000	
	COWAY CO LTD	4,084	56,500.000	230,746,000.000	
	KT&G CORP	8,543	85,900.000	733,843,700.000	
	KAKAO CORP	25,719	43,100.000	1,108,488,900.000	
	KUM YANG CO LTD	2,599	87,500.000	227,412,500.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	7,741	30,300.000	234,552,300.000	
	SK TELECOM CO LTD	3,745	51,400.000	192,493,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	22,468	7,190.000	161,544,920.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,142	188,000.000	214,696,000.000	
	LG UPLUS CORP	17,131	9,720.000	166,513,320.000	
	DOOSAN ENERBILITY	35,773	19,450.000	695,784,850.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	47,050.000	198,786,250.000	
	LG H&H CO LTD	762	400,000.000	304,800,000.000	
	LG CHEM LTD	4,078	370,500.000	1,510,899,000.000	
	LG CHEM LTD	599	263,000.000	157,537,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	34,460	46,200.000	1,592,052,000.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	20,327	18,410.000	374,220,070.000	
	S-OIL CORP	3,289	66,900.000	220,034,100.000	

HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	9,175	29,750.000	272,956,250.000	
POSCO FUTURE M CO LTD	2,467	275,000.000	678,425,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,312	110,300.000	144,713,600.000	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,314	134,700.000	446,395,800.000	
HYUNDAI MOBIS	4,809	221,500.000	1,065,193,500.000	
SK HYNIX INC	44,109	208,000.000	9,174,672,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,695	33,100.000	188,504,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,864	156,900.000	292,461,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	10,993	267,500.000	2,940,627,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,856	29,200.000	229,395,200.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	13,420.000	292,354,700.000	
KIA CORPORATION	21,109	121,400.000	2,562,632,600.000	
KOREA ZINC CO LTD	676	488,000.000	329,888,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,038	19,760.000	415,710,880.000	
KOREAN AIR CO LTD	14,033	21,950.000	308,024,350.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	142,600.000	172,403,400.000	
KT CORP	3,119	36,800.000	114,779,200.000	
HLB INC	9,430	59,200.000	558,256,000.000	
LG ELECTRONICS INC	8,378	100,600.000	842,826,800.000	
LG CORP	7,791	80,500.000	627,175,500.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,234	11,930.000	110,161,620.000	
NAVER CORP	10,590	170,700.000	1,807,713,000.000	
L&F CO LTD	2,034	162,800.000	331,135,200.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	68,400.000	235,501,200.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,851	377,000.000	2,205,827,000.000	
SAMSUNG E&A CO LTD	12,226	22,900.000	279,975,400.000	
COSMOAM&T CO LTD	1,730	165,600.000	286,488,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,502	393,000.000	1,769,286,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,673	150,900.000	705,155,700.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	385,943	75,700.000	29,215,885,100.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	54,110	9,320.000	504,305,200.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	2,834	214,000.000	606,476,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	66,036	62,500.000	4,127,250,000.000	
YUHAN CORP	4,700	78,400.000	368,480,000.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	42,700.000	162,388,100.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,592	10,050.000	237,099,600.000	
CELLTRION INC	12,428	189,500.000	2,355,106,000.000	

HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,614	160,000.000	578,240,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	23,172	59,700.000	1,383,368,400.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,620	183,000.000	296,460,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,314	93,100.000	122,333,400.000	
POSCO DX CO LTD	4,364	38,150.000	166,486,600.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,563	83,600.000	548,666,800.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,280	176,100.000	401,508,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,855	101,300.000	491,811,500.000	
ECOPRO CO LTD	7,950	103,700.000	824,415,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	713	363,000.000	258,819,000.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,242	243,000.000	301,806,000.000	
SK INC	2,945	188,600.000	555,427,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	31,100	78,400.000	2,438,240,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,645	52,000.000	293,540,000.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,042	75,200.000	604,758,400.000	
HANMI PHARM CO LTD	585	283,500.000	165,847,500.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	44,550.000	246,406,050.000	
HANJIN KAL CORP	2,068	66,300.000	137,108,400.000	
HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SYSTEM CO LTD	1,799	284,500.000	511,815,500.000	
HD HYUNDAI CO LTD	3,943	67,500.000	266,152,500.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	97,900.000	197,072,700.000	
NETMARBLE CORP	2,112	57,700.000	121,862,400.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	48,505	14,100.000	683,920,500.000	
ECOPRO BM CO LTD	3,906	215,500.000	841,743,000.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,210	82,000.000	181,220,000.000	
ENCHEM CO LTD	933	278,000.000	259,374,000.000	
KRAFTON INC	2,300	254,500.000	585,350,000.000	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	1,066	127,000.000	135,382,000.000	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,930	129,400.000	249,742,000.000	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,878	44,550.000	83,664,900.000	
SK SQUARE CO LTD	8,002	89,800.000	718,579,600.000	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	52,200.000	122,148,000.000	
HYBE CO LTD	1,649	202,500.000	333,922,500.000	
LG ENERGY SOLUTION	3,851	353,000.000	1,359,403,000.000	
KAKAObANK CORP	13,292	22,400.000	297,740,800.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,513	154,600.000	543,109,800.000	
ALTEOGEN INC	3,259	253,000.000	824,527,000.000	
SAMSUNG C&T CORP	6,833	133,600.000	912,888,800.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,415	736,000.000	1,041,440,000.000	

	DOOSAN BOBCAT INC	4,542	54,600.000	247,993,200.000	
韓国・ウォン 小計		1,250,297		97,622,796,460.000 (11,158,285,635)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	16.860	1,483,680.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	8.440	860,880.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	8,700	122.700	1,067,490.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	100,000	18.140	1,814,000.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,500	28.950	1,230,375.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	320,000	5.540	1,772,800.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	476,000	3.860	1,837,360.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	179,000	18.060	3,232,740.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	51,000	26.200	1,336,200.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	234,000	6.980	1,633,320.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	691,600	7.020	4,855,032.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	320,120	15.360	4,917,043.200	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	261,388	29.100	7,606,390.800	
	CITIC LTD	463,000	8.030	3,717,890.000	
	LENOVO GROUP LTD	656,000	10.640	6,979,840.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,696,000	7.750	13,144,000.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	8.780	1,021,904.200	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,967,200	4.890	9,619,608.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	10.620	785,880.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	221,000	7.920	1,750,320.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,100	70.700	4,531,870.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	324,000	7.830	2,536,920.000	
	HISENSE KELON ELECTRICAL HOLDINGS CO LTD	28,000	32.950	922,600.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	108,000	12.660	1,367,280.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	5.690	1,763,900.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	199,000	7.650	1,522,350.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	482,000	9.750	4,699,500.000		
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	77,000	28.550	2,198,350.000		

BYD CO LTD	84,500	228.000	19,266,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	7.600	1,216,000.000	
MMG LTD	252,000	3.300	831,600.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	138.500	1,385,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	561,788	10.140	5,696,530.320	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.720	814,680.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	153,200	23.600	3,615,520.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	11.660	2,215,400.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	608,000	11.300	6,870,400.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	439,000	17.500	7,682,500.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	194,400	4.490	872,856.000	
WEICHAO POWER CO LTD	152,440	14.840	2,262,209.600	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	11.720	1,336,080.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	9.800	1,764,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	50,000	55.550	2,777,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	206,000	4.700	968,200.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	129,333	31.300	4,048,122.900	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	94,000	5.380	505,720.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	823,250	2.850	2,346,262.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	263,000	14.300	3,760,900.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	534,100	374.800	200,180,680.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	544,000	38.100	20,726,400.000	
LI NING CO LTD	193,500	20.850	4,034,475.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	268,000	2.780	745,040.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	348,000	3.880	1,350,240.000	
ZTE CORP	63,288	16.780	1,061,972.640	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	272,000	39.800	10,825,600.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	221,250	15.040	3,327,600.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	686,205	5.990	4,110,367.950	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	170,250	10.840	1,845,510.000	

AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	51,500	26.900	1,385,350.000	
BAIDU INC	184,800	94.600	17,482,080.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,748,530	5.660	43,856,679.800	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	66,700	83.300	5,556,110.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	408,000	3.080	1,256,640.000	
BANK OF CHINA LTD	6,371,200	3.790	24,146,848.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	320,470	35.450	11,360,661.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,252,235	4.420	23,214,878.700	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	126,500	15.100	1,910,150.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	147,600	4.180	616,968.000	
CHINA COAL ENERGY CO	171,000	9.820	1,679,220.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	23.900	1,314,500.000	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	37,600	30.000	1,128,000.000	
CMOC GROUP LIMITED	315,000	7.330	2,308,950.000	
CHINA CITIC BANK-H	678,800	4.820	3,271,816.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	58,700	47.550	2,791,185.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	102,200	87.250	8,916,950.000	
FOSUN INTERNATIONAL	242,028	4.780	1,156,893.840	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	316,000	4.630	1,463,080.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,200	26.050	1,985,010.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,821,000	1.400	2,549,400.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	48,000	19.360	929,280.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	351,000	4.430	1,554,930.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	63,500	35.550	2,257,425.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	423,000	4.720	1,996,560.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	208,200	20.600	4,288,920.000	
CRRG CORP LTD - H	342,000	5.010	1,713,420.000	
SINOPHARM GROUP CO	104,000	22.550	2,345,200.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	214,527	3.140	673,614.780	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	230,500	12.880	2,968,840.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	228,000	8.050	1,835,400.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	70,400	12.360	870,144.000	

CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	168,800	9.760	1,647,488.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	155,000	12.520	1,940,600.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	85,200	16.080	1,370,016.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	531,656	2.960	1,573,701.760	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.590	587,930.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,224,000	3.310	7,361,440.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	68,000	13.900	945,200.000	
FAR EAST HORIZON LTD	169,000	5.200	878,800.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	129,000	12.500	1,612,500.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	239,600	3.860	924,856.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	672,000	2.720	1,827,840.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	265,000	4.250	1,126,250.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	670,000	4.570	3,061,900.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	84,000	9.400	789,600.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	17.760	1,136,640.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,674,000	0.990	3,637,260.000	
XIAOMI CORP	1,238,800	17.620	21,827,656.000	
BEIGENE LTD	54,600	95.350	5,206,110.000	
WUXI APPTec CO LTD	24,112	33.600	810,163.200	
MEITUAN	410,610	110.400	45,331,344.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	104,800	17.560	1,840,288.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	16.580	2,254,880.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	4.430	1,709,980.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	98,500	35.800	3,526,300.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	40,300	27.300	1,100,190.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	133,000	5.150	684,950.000	
HANSHO PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	88,000	17.820	1,568,160.000	
CHINA FEIHE LTD	341,000	3.960	1,350,360.000	



ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,258,968	77.100	97,066,432.800	
JD.COM INC	188,535	115.700	21,813,499.500	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	140,000	8.500	1,190,000.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	63.100	479,560.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	186,200	52.300	9,738,260.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	197,800	29.800	5,894,440.000	
BILIBILI INC	19,180	113.600	2,178,848.000	
AKESO INC	50,000	40.650	2,032,500.000	
NETEASE INC	156,600	146.900	23,004,540.000	
HORIZON CONSTRUCTION DEVELOPMENT LTD	31,296	1.950	61,027.200	
NONGFU SPRING CO LTD	163,600	41.350	6,764,860.000	
LI AUTO INC	100,500	78.100	7,849,050.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	88,050	25.300	2,227,665.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	30,400	33.950	1,032,080.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	63,200	28.200	1,782,240.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	5.650	921,859.650	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	117,900	60.100	7,085,790.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	35,600	38.200	1,359,920.000	
JD LOGISTICS INC	148,100	8.500	1,258,850.000	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	24,000	50.900	1,221,600.000	
TRIP.COM GROUP LTD	44,500	399.000	17,755,500.000	
XPENG INC	101,300	32.400	3,282,120.000	
MINISO GROUP HOLDING LTD	28,600	42.750	1,222,650.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	42,000	22.450	942,900.000	
CGN POWER CO LTD	826,000	3.180	2,626,680.000	
GF SECURITIES CO LTD	83,200	7.080	589,056.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	44.900	2,173,160.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	80,600	8.990	724,594.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	172,500	5.920	1,021,200.000	
CHINA LITERATURE LTD	37,600	26.300	988,880.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	25,000	14.560	364,000.000	
BOC AVIATION LTD	18,300	57.850	1,058,655.000	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	12.440	1,219,120.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	9.340	1,146,952.000	

	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	308,000	11.380	3,505,040.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	1.930	1,003,600.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,040	20.650	682,276.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	14.940	896,400.000	
香港・ドル	小計	64,290,200		943,236,202.840 (18,996,777,126)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	40,633	532.000	21,616,756.000	
	ACER INC	237,661	49.650	11,799,868.650	
	ASUSTEK COMPUTER INC	57,108	484.000	27,640,272.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	39,932	530.000	21,163,960.000	
	ASIA CEMENT CORP	164,778	41.400	6,821,809.200	
	TAIWAN BUSINESS BANK	498,399	17.300	8,622,302.700	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	76,954	111.000	8,541,894.000	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	41,646	309.500	12,889,437.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,335	185.500	10,635,642.500	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	109,525	184.000	20,152,600.000	
	QUANTA COMPUTER INC	215,697	273.000	58,885,281.000	
	EVA AIRWAYS CORP	228,765	36.900	8,441,428.500	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,554	222.500	11,248,265.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	445,423	18.350	8,173,512.050	
	CHINA AIRLINES	231,823	23.100	5,355,111.300	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	160,684	50.400	8,098,473.600	
	CHINA STEEL CORP	964,670	23.700	22,862,679.000	
	ADVANTECH CO LTD	38,979	359.500	14,012,950.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	353,445	36.100	12,759,364.500	
	DELTA ELECTRONICS INC	158,235	345.000	54,591,075.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	110,788	64.800	7,179,062.400	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	300,565	126.500	38,021,472.500	
	AUO CORP	526,500	18.050	9,503,325.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	147,784	107.000	15,812,888.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	83,482	218.000	18,199,076.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	225,768	34.550	7,800,284.400	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	161.500	6,481,156.500	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	14,780	551.000	8,143,780.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	46,961	606.000	28,458,366.000	

FORTUNE ELECTRIC CO LTD	9,804	742.000	7,274,568.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	312,857	62.700	19,616,133.900	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	281,026	52.000	14,613,352.000	
MEDIATEK INC	122,945	1,275.000	156,754,875.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	630,238	76.000	47,898,088.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	727,923	25.200	18,343,659.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	23,556	629.000	14,816,724.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	150,343	84.900	12,764,120.700	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	826,220	31.800	26,273,796.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	775,894	58.200	45,157,030.800	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,234,386	15.400	19,009,544.400	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,137,113	28.950	32,919,421.350	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,008,195	177.500	178,954,612.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	909,173	39.350	35,775,957.550	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,159	2,365.000	19,296,035.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	934,391	18.800	17,566,550.800	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,048,098	9.730	10,197,993.540	
INVENTEC CO LTD	220,927	53.000	11,709,131.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	165,221	107.000	17,678,647.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	836,686	23.500	19,662,121.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,434,831	37.200	53,375,713.200	
ASIA VITAL COMPONENTS CO LTD	26,609	620.000	16,497,580.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	859,997	27.800	23,907,916.600	
NAN YA PLASTICS CORP	375,894	50.800	19,095,415.200	
WISTRON CORP	210,211	109.500	23,018,104.500	
POU CHEN CORP	168,225	37.550	6,316,848.750	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	389,625	80.300	31,286,887.500	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	43,796	273.500	11,978,206.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	87,341	65.800	5,747,037.800	
E INK HOLDINGS INC	68,620	215.000	14,753,300.000	

	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	47.550	5,778,133.350	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	106,935	82.600	8,832,831.000	
	TAIWAN CEMENT CORP	548,163	33.050	18,116,787.150	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,989,940	879.000	1,749,157,260.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	899,843	55.100	49,581,349.300	
	WAN HAI LINES LTD	51,482	96.200	4,952,568.400	
	WALSIN LIHWA CORP	221,605	37.350	8,276,946.750	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	247,693	24.450	6,056,093.850	
	YAGEO CORP	27,165	678.000	18,417,870.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	144,188	82.900	11,953,185.200	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	30.150	4,385,769.750	
	GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,605.000	11,080,920.000	
	INNOLUX CORPORATION	691,396	13.650	9,437,555.400	
	WPG HOLDINGS CO LTD	133,481	86.300	11,519,410.300	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	4,925	2,385.000	11,746,125.000	
	PEGATRON CORP	158,874	111.500	17,714,451.000	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	6,436	2,920.000	18,793,120.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,248	1,010.000	11,360,480.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	120,333	153.000	18,410,949.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	56,562	116.500	6,589,473.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	836,951	25.850	21,635,183.350	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	322,570	46.200	14,902,734.000	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	4,934	1,735.000	8,560,490.000	
	WIWYNN CORP	7,791	2,630.000	20,490,330.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	267,472	159.500	42,661,784.000	
	SILERGY CORP	26,396	491.000	12,960,436.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	17,593	484.000	8,515,012.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	22,335	542.000	12,105,570.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,658	375.000	5,496,750.000	
	台湾・ドル 小計	27,912,164		3,575,661,032.790 (17,441,359,386)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	27,835	241.040	6,709,348.400	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	297.870	5,717,912.520	
	DISCOVERY LTD	42,619	112.460	4,792,932.740	
	GOLD FIELDS LTD	71,833	290.400	20,860,303.200	
	REMGRO LTD	41,148	124.130	5,107,701.240	

HARMONY GOLD MINING CO LTD	43,521	156.510	6,811,471.710	
EXXARO RESOURCES LTD	21,000	172.600	3,624,600.000	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,963	2,158.600	15,030,331.800	
MTN GROUP LTD	135,077	80.220	10,835,876.940	
FIRSTRAND LTD	409,321	63.340	25,926,392.140	
NASPERS LTD	14,368	3,845.070	55,245,965.760	
NEDBANK GROUP LTD	37,719	223.130	8,416,240.470	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,842	573.740	3,351,789.080	
SASOL LTD	48,138	120.020	5,777,522.760	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,769	248.360	9,877,028.840	
STANDARD BANK GROUP LTD	106,544	182.500	19,444,280.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	78,996	54.000	4,265,784.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	229.360	6,919,103.120	
ABSA GROUP LTD	70,074	149.960	10,508,297.040	
SANLAM LTD	139,073	71.480	9,940,938.040	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	69,363	87.100	6,041,517.300	
KUMBA IRON ORE LTD	5,386	454.790	2,449,498.940	
OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	41.280	2,904,048.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	51,779	90.470	4,684,446.130	
NEPI ROCKCASTLE NV	45,937	133.390	6,127,536.430	
OLD MUTUAL LTD	391,487	10.300	4,032,316.100	
REINET INVESTMENTS SCA	11,620	480.000	5,577,600.000	
PEPKOR HOLDINGS LTD	169,735	17.180	2,916,047.300	
SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	20.880	4,677,934.320	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	30,906	110.320	3,409,549.920	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	34,335	418.950	14,384,648.250	
BID CORP LTD	26,051	426.000	11,097,726.000	
南アフリカ・ランド 小計	2,520,191		307,466,688.490 (2,579,645,516)	
合計	604,668,416		93,800,415,815 (93,800,415,815)	

## (2) 株式以外の有価証券

2024年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	91,500.000	2,891,400.000	
		ENERGISA SA	19,900.000	912,415.000	
		KLABIN SA	65,450.000	1,306,382.000	
	ブラジル・リアル	小計	176,850.000	5,110,197.000 (150,070,644)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,205,475.000	14,682,685.500	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		39,900.000	6,443,850.000		

		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	154,410.000	30,882,000.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,399,785.000	52,008,535.500 (444,875,812)	
投資信託受益証券 合計			1,576,635	594,946,456 (594,946,456)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	229,200.000	5,409,120.000	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA DE CV	69,100.000	4,402,361.000	
	メキシコ・ペソ	小計	298,300.000	9,811,481.000 (83,926,427)	
投資証券 合計			298,300	83,926,427 (83,926,427)	
合計				678,872,883 (678,872,883)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 41銘柄	2.62	-	-	2.74
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.03	-	-	1.08
インド・ルピー	株式 146銘柄	18.08	-	-	18.93
インドネシア・ルピア	株式 21銘柄	1.53	-	-	1.60
オフショア・人民元	株式 432銘柄	3.94	-	-	4.12
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.74	-	-	0.77
クウェート・ディナール	株式 6銘柄	0.72	-	-	0.75
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.11	-	-	0.11
サウジアラビア・リアル	株式 42銘柄	3.74	-	-	3.92
タイ・バーツ	株式 32銘柄	1.29	-	-	1.35
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.14	-	-	0.14
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.45	-	-	0.47
トルコ・リラ	株式 17銘柄	0.72	-	-	0.76
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.23	-	-	0.24
フィリピン・ペソ	株式 13銘柄	0.50	-	-	0.53
ブラジル・レアル	株式 45銘柄 投資信託受益証 券 3銘柄	4.02 -	- 0.15	- -	4.37
ポーランド・ズロチ	株式 13銘柄	0.88	-	-	0.92
マレーシア・リンギット	株式 32銘柄	1.33	-	-	1.39
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄	1.54	-	-	2.17

	投資信託受益証券	3銘柄	-	0.45	-	
	投資証券	2銘柄	-	-	0.08	
ユーロ	株式	11銘柄	0.50	-	-	0.53
韓国・ウォン	株式	98銘柄	11.28	-	-	11.81
香港・ドル	株式	158銘柄	19.21	-	-	20.11
台湾・ドル	株式	88銘柄	17.64	-	-	18.46
南アフリカ・ランド	株式	32銘柄	2.61	-	-	2.73

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2024年6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	808,276,804
コール・ローン	117,902,092
国債証券	114,909,559,000
派生商品評価勘定	1,271
未収利息	1,233,262,125
前払費用	171,874,451
流動資産合計	117,240,875,743
資産合計	117,240,875,743
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,561,000
流動負債合計	3,561,000
負債合計	3,561,000
純資産の部	
元本等	
元本	47,961,580,274
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	69,275,734,469
元本等合計	117,237,314,743
純資産合計	117,237,314,743
負債純資産合計	117,240,875,743



## 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12月12日 至 2024年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,685,016,199円
同期中追加設定元本額	15,933,503,770円
同期中一部解約元本額	11,656,939,695円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファン ドラップ）	54,988,132円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,492,245,819円
たわらノーロード バランス（堅実型）	183,131,690円
たわらノーロード バランス（標準型）	611,730,981円
たわらノーロード バランス（積極型）	296,949,013円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	479,908円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	4,766,458円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	65,687,859円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	7,870,171円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	9,031,154円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	62,340,964円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	257,581,449円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	409,557,576円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	839,267,166円
投資のソムリエ	11,685,155,909円
クルーズコントロール	253,128,399円
投資のソムリエ<DC年金>	1,240,380,702円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	371,367,054円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	860,375,615円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,636,183,896円
ワールドアセットバランス（基本コース）	314,205,372円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	810,502,060円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	81,015,853円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	42,015,639円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,980,067円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	266,738,820円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	302,803,970円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	214,655,061円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	96,960,633円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	44,946,698円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	27,313,225円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,904,864円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	2,036,677円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	18,691,478円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	18,354,943,481円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	186,294,690円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	881,619,376円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2(適格機関投資家限定)	577,474,520円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	6,860,192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)	83,680,515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)	56,153,305円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,235,563,863円
計	47,961,580,274円
2. 受益権の総数	47,961,580,274口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月12日 至 2024年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年6月11日現在
----	--------------

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	1,624,238,372	
合計	1,624,238,372	

(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(2024年4月19日から2024年6月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年6月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	100,000,000	-	100,001,271	1,271	
	100,000,000	-	100,001,271	1,271	
合計	100,000,000	-	100,001,271	1,271	

## (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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,444円 (24,444円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2024年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	8,000,000.000	7,028,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	6,000,000.000	4,909,500.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	8,000,000.000	6,531,492.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	6,000,000.000	5,853,414.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	7,000,000.000	6,225,810.500	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,252,815.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	5,000,000.000	4,542,255.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	6,000,000.000	4,133,229.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	4,000,000.000	3,139,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 4.875 04/30/29	2,000,000.000	1,993,880.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 5.0 04/30/34	3,000,000.000	3,007,320.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 5.5 04/30/54	1,000,000.000	998,809.750	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	4,000,000.000	3,880,253.720	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	14,000,000.000	11,954,879.580	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	9,000,000.000	7,940,861.460	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	8,000,000.000	7,508,244.960	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	9,000,000.000	6,499,403.640	
BRAZIL 6.0 10/20/33	10,000,000.000	9,690,420.100			
BRAZIL 6.125 03/15/34	3,000,000.000	2,906,110.920			

BRAZIL 7.125 05/13/54	3,000,000.000	2,920,523.400	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	4,000,000.000	3,284,766.000	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,687,190.960	
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	2,000,000.000	1,968,371.580	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	6,000,000.000	4,909,864.800	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	12,000,000.000	9,463,196.880	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	10,000,000.000	7,658,266.700	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	3,000,000.000	1,797,583.440	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	7,000,000.000	7,006,079.780	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	7,000,000.000	7,263,430.510	
COLOMBIA 8.0 11/14/35	3,000,000.000	3,089,121.900	
COLOMBIA 8.75 11/14/53	3,000,000.000	3,166,189.290	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	7,000,000.000	6,405,350.000	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	7,000,000.000	6,303,500.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	3,000,000.000	2,556,750.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	11,000,000.000	10,697,500.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	6,000,000.000	5,075,700.000	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	6,200,000.000	6,028,880.000	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	8,000,000.000	7,516,000.000	
HUNGARY 2.125 09/22/31	11,000,000.000	8,661,647.500	
HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	3,774,036.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	13,000,000.000	12,733,513.000	
HUNGARY 5.5 03/26/36	1,000,000.000	956,103.500	
HUNGARY 6.125 05/22/28	7,000,000.000	7,124,915.000	
HUNGARY 6.25 09/22/32	12,000,000.000	12,270,000.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,608,262.400	
INDONESIA 3.05 03/12/51	4,000,000.000	2,742,250.000	
INDONESIA 3.4 09/18/29	200,000.000	184,545.000	
INDONESIA 3.85 10/15/30	8,400,000.000	7,780,563.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,182,895.000	
INDONESIA 4.2 10/15/50	8,000,000.000	6,608,144.000	
INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,566,640.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	991,600.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	500,000.000	615,562.500	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	5,000,000.000	4,982,817.500	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	7,000,000.000	7,093,660.000	

OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	4,000,000.000	4,109,760.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	9,000,000.000	6,450,107.310	
PANAMA 3.16 01/23/30	7,000,000.000	5,864,085.150	
PANAMA 3.87 07/23/60	3,000,000.000	1,695,349.770	
PANAMA 4.5 01/19/63	8,000,000.000	5,058,548.560	
PANAMA 4.5 04/01/56	9,000,000.000	5,772,315.150	
PANAMA 6.4 02/14/35	7,000,000.000	6,604,285.590	
PERU 2.78 12/01/60	3,000,000.000	1,660,206.150	
PERU 2.783 01/23/31	9,000,000.000	7,630,679.790	
PERU 3.0 01/15/34	10,000,000.000	8,045,284.600	
PERU 3.55 03/10/51	7,000,000.000	4,903,370.780	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	5,000,000.000	3,245,120.000	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	7,000,000.000	4,956,343.000	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	1,200,000.000	1,019,732.560	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	6,006,938.970	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	5,000,000.000	4,033,617.850	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	6,200,000.000	5,801,177.180	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	3,000,000.000	1,836,792.600	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	8,000,000.000	5,847,843.280	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	4,000,000.000	2,860,061.200	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	10,200,000.000	8,816,979.550	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,527,202.000	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	7,000,000.000	6,008,180.430	
REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	1,000,000.000	983,338.020	
REPUBLIC OF CHILE 4.95 01/05/36	2,000,000.000	1,912,461.460	
REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	6,000,000.000	5,899,233.000	
REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	11,000,000.000	10,681,935.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	9,000,000.000	8,811,000.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	9,000,000.000	8,677,993.500	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	10,000,000.000	9,740,860.000	

REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	7,000,000.000	7,128,695.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	11,000,000.000	11,373,109.000	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	4,000,000.000	3,878,008.440	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	3,000,000.000	3,104,492.610	
ROMANIA 3.0 02/14/31	2,000,000.000	1,656,940.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	8,000,000.000	5,532,876.000	
ROMANIA 5.875 01/30/29	6,000,000.000	5,950,842.000	
ROMANIA 6.375 01/30/34	1,000,000.000	1,001,200.000	
ROMANIA 6.625 02/17/28	7,000,000.000	7,148,155.000	
ROMANIA 7.125 01/17/33	12,000,000.000	12,621,132.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	12,000,000.000	9,545,220.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	4,000,000.000	3,872,465.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	11,200,000.000	10,025,937.600	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	2,000,000.000	1,289,870.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	4,400,000.000	3,092,743.500	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	10,000,000.000	9,705,850.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,864,850.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	3,207,831.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30	1,000,000.000	978,267.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	10,000,000.000	9,868,612.500	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	9,000,000.000	8,745,849.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	4,000,000.000	3,515,788.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	2,000,000.000	1,849,650.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	12,000,000.000	12,204,792.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	2,000,000.000	1,944,460.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	13,000,000.000	11,797,500.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	400,000.000	389,550.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	14,000,000.000	10,221,400.000	

SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	10,000,000.000	8,725,000.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	6,000,000.000	5,887,200.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	5,000,000.000	4,723,993.750	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	8,000,000.000	7,702,340.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	5,000,000.000	4,296,500.000	
STATE OF QATAR 4.75 05/29/34	2,000,000.000	1,986,206.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	8,000,000.000	7,364,384.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	5,000,000.000	3,332,250.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	5,000,000.000	4,729,087.500	
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	2,000,000.000	2,003,388.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	4,000,000.000	3,260,082.080	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,226,246.960	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	8,000,000.000	6,452,993.040	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	4,000,000.000	2,380,475.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,452,583.560	
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	7,000,000.000	5,415,296.950	
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	3,000,000.000	2,176,446.480	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	6,000,000.000	4,501,873.500	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	5,000,000.000	4,748,103.750	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	6,000,000.000	5,521,787.700	
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	6,000,000.000	5,509,762.560	
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	6,000,000.000	4,799,394.780	
UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36	2,000,000.000	1,939,893.180	
UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	5,000,000.000	4,688,084.400	
UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	10,000,000.000	10,006,096.300	



	UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	2,000,000.000	1,893,763.660	
	アメリカ・ドル 小計	833,100,000.000 (131,071,623,000)	730,372,840.520 (114,909,559,000)	
国債証券 合計		131,071,623,000 (131,071,623,000)	114,909,559,000 (114,909,559,000)	
合計			114,909,559,000 (114,909,559,000)	

(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 139銘柄	98.01	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## ワールドアセットバランス（基本コース）

2024年6月28日現在

資産総額	5,107,073,448円
負債総額	119,849,198円
純資産総額（ - ）	4,987,224,250円
発行済数量	5,234,884,055口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9527円

## ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2024年6月28日現在

資産総額	15,060,487,647円
負債総額	236,831,345円
純資産総額（ - ）	14,823,656,302円
発行済数量	15,673,858,042口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9458円

（参考）

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	1,641,293,426,610円
負債総額	690,836,573円
純資産総額（ - ）	1,640,602,590,037円
発行済数量	168,094,547,165口
1口当たり純資産額（ / ）	9.7600円

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	251,258,004,335円
負債総額	6,473,240,702円
純資産総額（ - ）	244,784,763,633円
発行済数量	212,370,526,684口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1526円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	89,108,766,938円
負債総額	369,473,222円
純資産総額（ - ）	88,739,293,716円
発行済数量	42,601,966,394口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0830円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	103,599,064,195円
負債総額	23,054,137円
純資産総額（ - ）	103,576,010,058円
発行済数量	55,001,703,069口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8831円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	127,550,129,103円
負債総額	3,068,151,494円
純資産総額( - )	124,481,977,609円
発行済数量	49,167,298,168口
1口当たり純資産額( / )	2.5318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。

## 第二部【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6月28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6月28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. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年6月28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	1,533,911,061,012
追加型株式投資信託	766	17,232,840,003,341
単位型公社債投資信託	21	32,630,984,099
単位型株式投資信託	197	1,068,820,876,122
合計	1,010	19,868,202,924,574

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第39期事業年度(自2023年4月1日至2024年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。



## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：百万円 )

	第38期 ( 2023年3月31日現在 )	第39期 ( 2024年3月31日現在 )
( 資産の部 )		
流動資産		
現金・預金	33,770	41,183
金銭の信託	29,184	28,143
未収委託者報酬	16,279	19,018
未収運用受託報酬	3,307	3,577
未収投資助言報酬	283	315
未収収益	15	6
前払費用	1,129	1,510
その他	2,377	2,088
流動資産計	86,346	95,843
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,001	918
器具備品	118	130
リース資産	7	5
建設仮勘定	-	39
無形固定資産		
ソフトウェア	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産		
投資有価証券	182	184
関係会社株式	5,810	4,447
長期差入保証金	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

(単位:百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
(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	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
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	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	95,739		102,113	
運用受託報酬	16,150		17,155	
投資助言報酬	2,048		2,211	
その他営業収益	23		26	
営業収益計		113,962		121,507
営業費用				
支払手数料	41,073		44,366	
広告宣伝費	216		329	
公告費	0		0	
調査費	33,177		35,468	
調査費	12,294		13,277	
委託調査費	20,882		22,190	
委託計算費	548		558	
営業雑経費	733		823	
通信費	36		36	
印刷費	504		598	
協会費	69		65	
諸会費	29		44	
支払販売手数料	92		78	
営業費用計		75,749		81,545
一般管理費				
給料	10,484		10,763	
役員報酬	168		164	
給料・手当	9,199		9,425	
賞与	1,115		1,173	
交際費	17		34	
寄付金	11		15	
旅費交通費	128		162	
租税公課	330		489	
不動産賃借料	1,006		1,030	
退職給付費用	437		412	
固定資産減価償却費	1,388		1,567	
福利厚生費	47		46	
修繕費	1		1	
賞与引当金繰入額	1,730		1,927	
役員賞与引当金繰入額	48		52	
機器リース料	0		0	
事務委託費	4,074		3,379	
事務用消耗品費	37		46	
器具備品費	1		3	
諸経費	334		240	
一般管理費計		20,078		20,172
営業利益		18,135		19,788

(単位:百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		10		4
受取配当金	1	2,400	1	899
時効成立分配金・償還金		0		0
雑収入		10		18
時効後支払損引当金戻入額		24		35
営業外収益計		2,446		959
営業外費用				
為替差損		3		19
金銭の信託運用損		1,003		1,008
早期割増退職金		24		6
雑損失		47		0
営業外費用計		1,079		1,034
経常利益		19,502		19,712
特別利益				
投資有価証券売却益		4		-
特別利益計		4		-
特別損失				
固定資産除却損		12		6
投資有価証券売却損		9		-
関係会社株式評価損		584		1,362
減損損失		-	2	231
特別損失計		606		1,601
税引前当期純利益		18,900		18,111
法人税、住民税及び事業税		4,881		5,769
法人税等調整額		197		510
法人税等合計		5,078		5,258
当期純利益		13,821		12,852

## （３）【株主資本等変動計算書】

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

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							11,040	11,040	11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	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	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			11,040
当期純利益			12,852
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	1,812
当期末残高	0	0	80,846

## 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、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

## 6. 収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投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**

## （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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
建物	523	630
器具備品	934	769
リース資産	1	3

## （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38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）
受取配当金	2,393	895

## 2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

当社は、キャッシュ・フローを生み出す最小単位として、主として事業別に資産をグルーピングしております。当社の資産運用業に係るソフトウェア開発計画の大幅な延期に伴い、当該計画に係るソフトウェア仮勘定について、回収可能額まで減額し、当該減少額231百万円を減損損失として特別損失に計上いたしました。なお、当該資産の回収可能額は使用価値により測定しており、使用価値については、将来キャッシュ・フローが見込まれないため、備忘価額の1円として評価しております。

## （株主資本等変動計算書関係）

## 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

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(予定)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					

## 第39期（自 2023年4月1日 至 2024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
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

2024年6月17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(予定)日
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

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	-

## 第39期(2024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	28,143	28,143	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,145	28,145	-

(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	-	-

## 第39期(2024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	41,183	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,143	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	19,018	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,577	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	91,923	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

## 第39期（2024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	-	28,143	-	28,143
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,145	-	28,145

（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（預金・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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	180	182
関係会社株式		
非上場株式	5,810	4,447

## (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38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円)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。

第39期(2024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。

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、有価証券について1,362百万円(関係会社株式1,362百万円)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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	191	246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	44	40
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	22	13
過去勤務費用の費用処理額	34	0
その他	4	4
確定給付制度に係る退職給付費用	334	307

(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24百万円、当事業年度において6百万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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.56%	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103百万円、当事業年度104百万円であります。



## (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38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	121	195
未払事業所税	9	9
賞与引当金	529	590
未払法定福利費	94	98
運用受託報酬	390	351
資産除去債務	15	17
減価償却超過額(一括償却資産)	21	12
減価償却超過額	198	91
繰延資産償却超過額(税法上)	297	331
退職給付引当金	812	832
時効後支払損引当金	33	22
ゴルフ会員権評価損	7	6
関係会社株式評価損	345	761
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	-	70
その他	13	8
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	2,895	3,406
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,895	3,406

## 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38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	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 %	1.44 %
その他	0.06 %	0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.87 %	29.04 %

## (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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	68,921百万円	60,761百万円
資産合計	68,921百万円	60,761百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	3,643百万円	1,957百万円
負債合計	3,643百万円	1,957百万円
純資産	65,278百万円	58,804百万円

(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	51,451百万円	47,640百万円
顧客関連資産	20,947百万円	17,109百万円

## (2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,039百万円	7,649百万円
経常利益	8,039百万円	7,649百万円
税引前当期純利益	8,039百万円	7,649百万円
当期純利益	6,744百万円	6,474百万円
1株当たり当期純利益	168,617円97銭	161,850円28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	4,228百万円	3,837百万円

（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38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
委託者報酬	95,739百万円	102,113百万円
運用受託報酬	14,651百万円	15,156百万円
投資助言報酬	2,048百万円	2,211百万円
成功報酬（注）	1,499百万円	1,999百万円
その他営業収益	23百万円	26百万円
<b>合計</b>	<b>113,962百万円</b>	<b>121,507百万円</b>

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、当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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

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。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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	8,140	未払 手数料	1,870
	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	16,655	未払 手数料	3,137

## 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
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	13,821百万円	12,852百万円
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種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

(注1) A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（2024年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(注) 資本金の額は2024年3月末日現在

## (3) 投資顧問会社

名称	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社
資本金の額	200百万円（2024年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

## 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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社は委託会社との投資顧問契約に基づき、各ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

### 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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2024年3月11日	有価証券報告書
2024年3月11日	有価証券届出書

## 独立監査人の監査報告書

2024年5月23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

## 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2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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

2024年8月9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」に掲げられているワールドアセットバランス(基本コース)の2023年12月12日から2024年6月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス(基本コース)の2024年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年8月9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」に掲げられているワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2023年12月12日から2024年6月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2024年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。