【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年10月11日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　杉原　規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	積木　利浩
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	マネックス資産設計ファンド　エボリューション
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド　エボリューション
なお、「マネックス資産設計ファンド　Evolution」という名称を用いる場合があります。
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。
なお、収益分配金の再投資については、各計算期間終了日の基準価額とします。
※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
　ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/
　コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）
・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※収益分配金の再投資については、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2024年10月12日から2025年4月14日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」に従って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は、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）にお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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

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

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

②当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

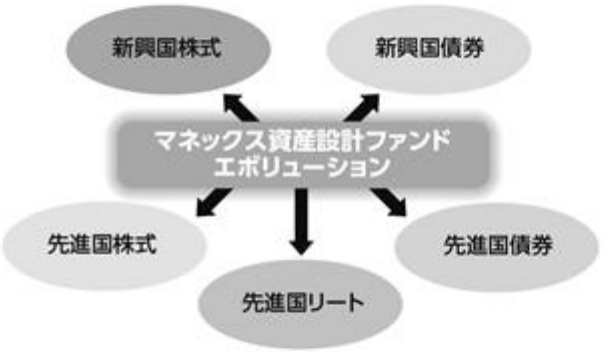
1 世界の株式、債券、リートを実質的な投資対象とし、分散された基本ポートフォリオを構築します。

●国内資産に偏らないグローバルな視点から資産配分比率を決定します。

●基本ポートフォリオの資産配分比率の決定にあたっては、資産配分の専門家であるイボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

●各資産への投資はマザーファンドを通じて行います。

●実質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は行いません。



<投資対象とするマザーファンド>

先進国株式	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
新興国株式	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
先進国債券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
新興国債券	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
先進国リート	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※リートとは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資家から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入等などが投資家に分配される商品をいいます。

2 投資対象に新興国資産を加えることで、相対的に高いリターンを狙います。

●高い経済成長が見込まれる新興国の資産を組み入れることで、先進国のみのポートフォリオよりも相対的に高いリターンが期待できます。

3 基本ポートフォリオの推定リスク水準は原則として日本株投資と同程度(※)としつつも、世界の複数資産へ高度な分散投資を行うことにより、効率の良い運用をめざします。

●基本ポートフォリオのリスク水準を過去の日本株と同程度とし、期待リターンが最大となる資産配分比率を選択することで、分散効果を享受した効率的な運用をめざします。

(※)過去30年間(1993年～2023年)の日経平均株価の標準偏差は概ね年率20%程度です。

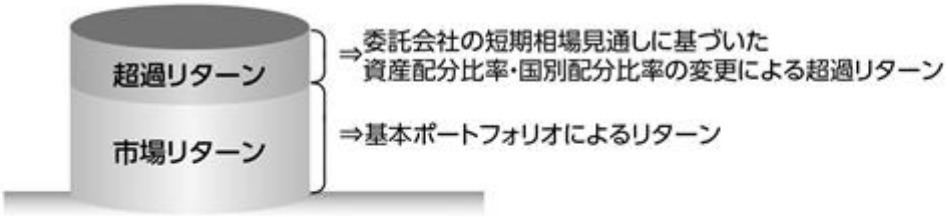
指数の著作権等
「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません。

4 経験豊富な運用チームによるアクティブアセットアロケーション運用により、超過収益の獲得をめざします。

●委託会社が短期相場見通しに基づき機動的に配分比率の変更を行うことで、基本ポートフォリオのリターンに加えて超過リターンの獲得を狙います。

●国別配分比率の変更にあたっては、先物取引を活用します。

ファンドのリターン獲得イメージ



※上記はあくまでもファンドのリターン獲得の構造イメージであり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

5 運用管理費用（信託報酬）は年率0.605%（税込）とし、購入時手数料はノーロードと低コストでご提供します。

※上記は過去の情報であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。
※上記の内容は、委託会社が信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の完全性、正確性を保証するものではありません。
※上記の内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

投資プロセス　～ポートフォリオができるまで～

①イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言による基本ポートフォリオの決定　見直し頻度:原則として年1回

●各資産のデータ分析をもとに、長期のリターン、リスク、相関の推計を行い、一定のリスク水準に対して期待リターンの最も高い資産配分比率を決定します。

※資産配分比率の決定にあたっては、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。
※基本ポートフォリオの国別配分比率は、各資産の代表的指数の国別配分比率を参考とします。なお、各資産の代表的指数は下記のとおりです。
※右記基本ポートフォリオはあくまでもイメージであり、実際のものとは異なります。

基本ポートフォリオ（例）

各5資産の定義
■先進国株式/MSCIワールド・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) ■先進国債券/FTSE世界国債インデックス(円ベース、為替ヘッジなし) ■先進国リート/S&P 先進国 REITインデックス(円ベース、配当込み、為替ヘッジなし) ■新興国株式/MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし） ■新興国債券/JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）

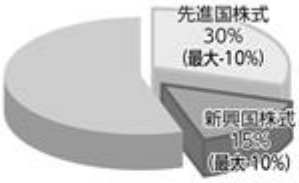
②委託会社による資産配分比率・国別配分比率の変更　見直し頻度:短期の相場見通しに基づき随時

●超過収益を獲得するために、相場環境の変化に対応し、基本ポートフォリオの資産配分比率・国別配分比率を機動的に変更します。
●オフバランス資産のポジションを考慮した実質組入比率は、原則として、純資産総額の範囲内で高位を維持します。

資産配分比率の変更（例）

株式に強気な見通しの場合

株式に弱気な見通しの場合

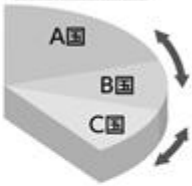


短期の相場見通しに基づき、資産配分比率を変更します。

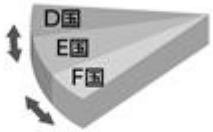
※資産配分比率の変更は、原則として基本ポートフォリオの比率から±10%の範囲で行います。ただし、当ファンドのリスクが一定水準を超えた場合には、先進国債券の比率を上記に関わらず、基本ポートフォリオの比率から+10%を超えて増加させることがあります。

国別配分比率の変更（例）

先進国株式



先進国債券



短期の相場見通しに基づき、先進国株式および先進国債券の国別配分比率を変更します。

※国別配分比率の変更は先進国株式、先進国債券を対象とします。
※国別配分比率の変更にあたっては先物取引を活用しますが、同一資産内の売り持ち、買い持ちのポジションは合計で0%を基本とします。

※上記の資産配分比率・国別比率は、あくまでもポートフォリオの決定までのプロセスを説明するためのものであり、実際のポートフォリオとは異なります。また、将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。
※上記の内容は、委託会社が信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の完全性、正確性を保証するものではありません。
※上記の内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

■分配方針

年1回の決算時（1月11日（休業日の場合は翌営業日））に、経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

○商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

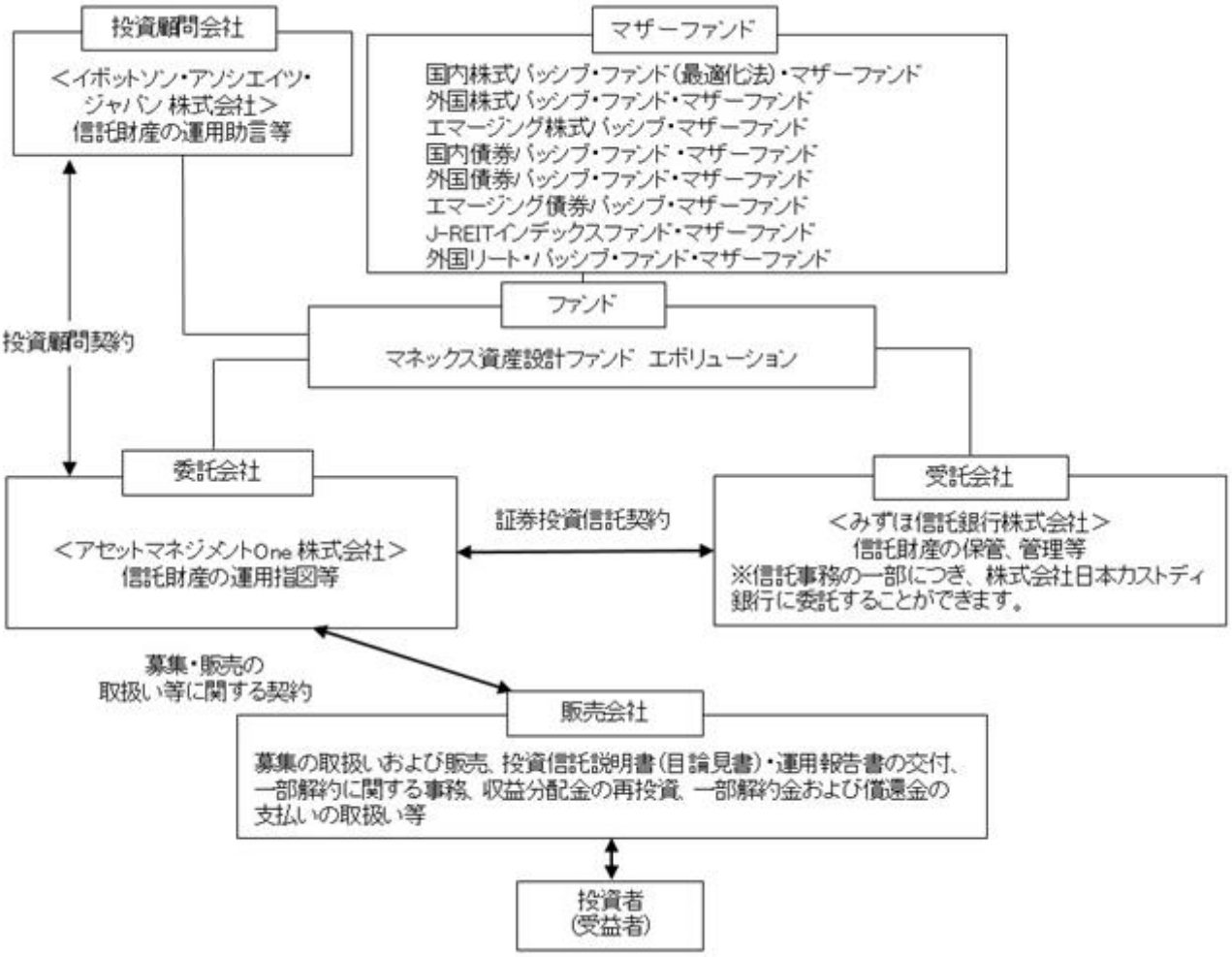
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

（２）【ファンドの沿革】

2010年5月28日　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2016年4月13日　外国リートの投資対象マザーファンドを「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」から「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」へ変更
2018年10月12日　信託期間を2025年1月14日までに変更（当初は2020年1月14日まで）
信託報酬率（税抜）を「年率1.00%」から「年率0.55%」に引き下げ
2023年10月12日　信託期間を2045年1月11日までに変更

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、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

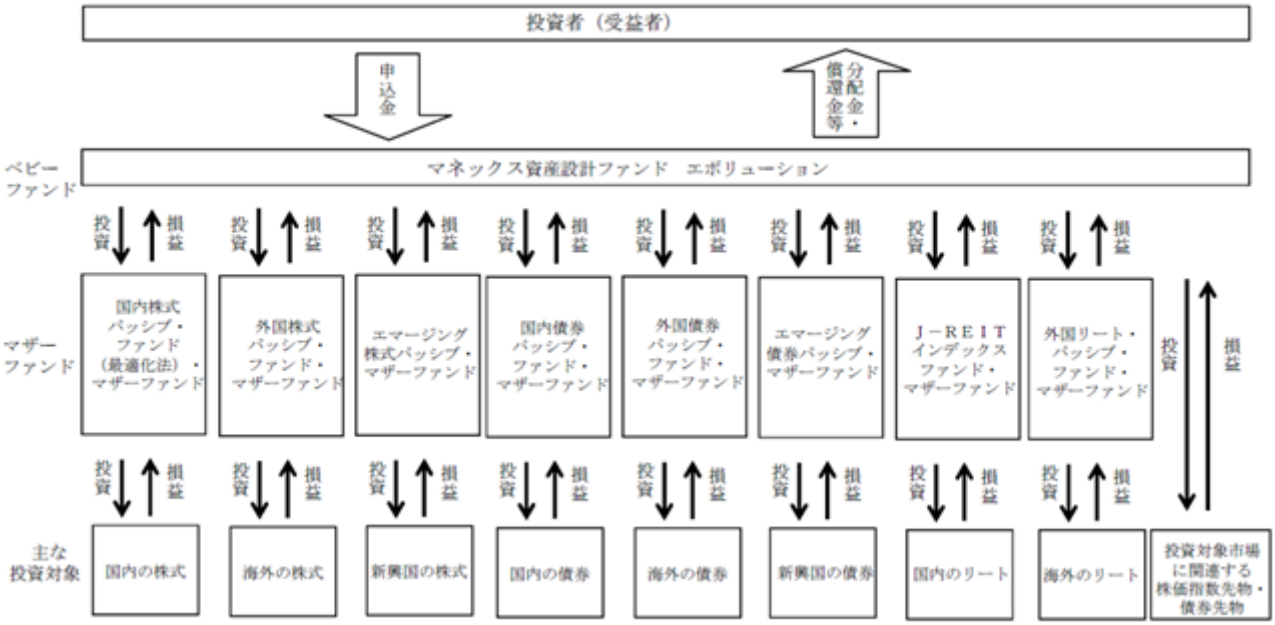
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○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7月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2024年7月31日現在）

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の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。

＜投資対象＞

主として、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、エマージング株式パッシブ・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、エマージング債券パッシブ・マザーファンド受益証券、Ｊ-ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド受益証券および外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券（以下それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）、投資対象市場に関連する株価指数先物および債券先物を主要投資対象とします。

＜投資態度＞

①当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券、投資対象市場に関連する株価指数先物および債券先物に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざします。

②原則として、各資産の長期のヒストリカルデータの分析により、一定のリスク水準において期待リターンが最大となる資産配分比率を基本ポートフォリオとします。

③基本ポートフォリオの資産配分比率の決定にあたっては、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき決定し、原則として、年1回見直しを行います。

④原則として、基本ポートフォリオの構築にあたっては、8つのパッシブマザーファンド受益証券への投資を通じて行います。

⑤短期的なマクロ分析・市場分析等に基づいて、実際のポートフォリオの資産比率および国別比率を一定の範囲内で基本配分比率から乖離させることにより、超過収益の獲得をめざします。なお、当該配分変更は、月次の定時リバランスに加えて、相場環境の変化に応じ機動的に実施します。

ｉ）資産配分比率の変更

・ 先進国株式、新興国株式、先進国債券、新興国債券、先進国リートの5資産クラスに対して相対魅力度を判定し、オーバーウェイト/アンダーウェイトの調整を実施します。

・ 配分比率の変更は、原則としてマザーファンド受益証券の売買で調整します。
・ 基本配分比率との乖離幅は±10%とします。
・ 上記に関わらず、当ファンドのボラティリティが一定水準を超えた場合には、相場急変時と判断し、先進国債券への比率を増加させることがあります。この場合、基本配分比率との乖離幅は以下の通りとします。
先進国債券以外の資産クラス：±10%
先進国債券　　：制限は設けません

ii）国別配分比率の変更
・ 先進国株式、先進国債券を対象に各構成国別の相対魅力度を判定し、オーバーウェイト／アンダーウェイトの調整を実施します。
・ 配分比率の変更は、原則として各国の株価指数先物および債券先物の買い持ち／売り持ちのポジションを構築することで調整します。
・ 同一資産クラス内における先物の買い持ち/売り持ちのポジションは合計で0%を基本とします。また、各構成国においてオンバランス資産以上のショートポジションは構築しません。

⑥オフバランス資産のポジションを考慮した実質組入比率は、原則として、純資産総額の範囲内で高位を維持します。
⑦原則として、外貨建資産の為替ヘッジは行いません。また、株価指数先物または債券先物のポジションを構築した場合において、想定元本部分にかかる為替リスクの調整は行いません。
⑧ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

（２）【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

ｂ．次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

2. 運用の指図範囲等（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、Ｊ-ＲＥＩＴ

インデックスファンド・マザーファンドおよび外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券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. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10.コマーシャル・ペーパー
11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.から11.の証券または証書の性質を有するもの
13.投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
14.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。）
15. 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。）
16.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、有価証券に係るものに限ります。）
17.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。）
18.外国法人が発行する譲渡性預金証書
19.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。）
20.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。）
21.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
22.外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

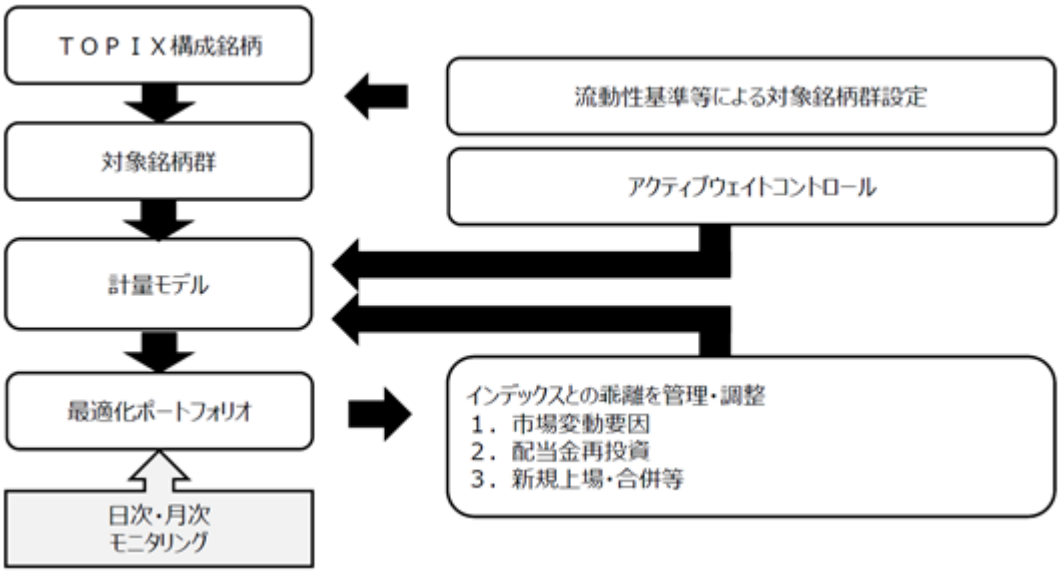
委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

投資態度	1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 ※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰX総研または株式会社ＪＰX総研の関連会社（以下「ＪＰX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰXが有しています。 ②ＪＰXは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③ＪＰXは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④ＪＰXは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰXは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰXにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。 ⑦ＪＰXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

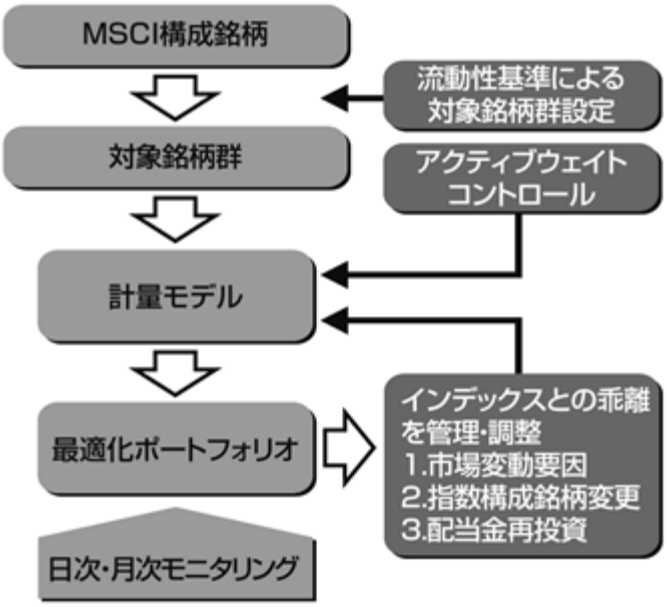
基本方針	**この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。**
主な投資対象	**海外の株式を主要投資対象とします。**

投資態度	**1.主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。**

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

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

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

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

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

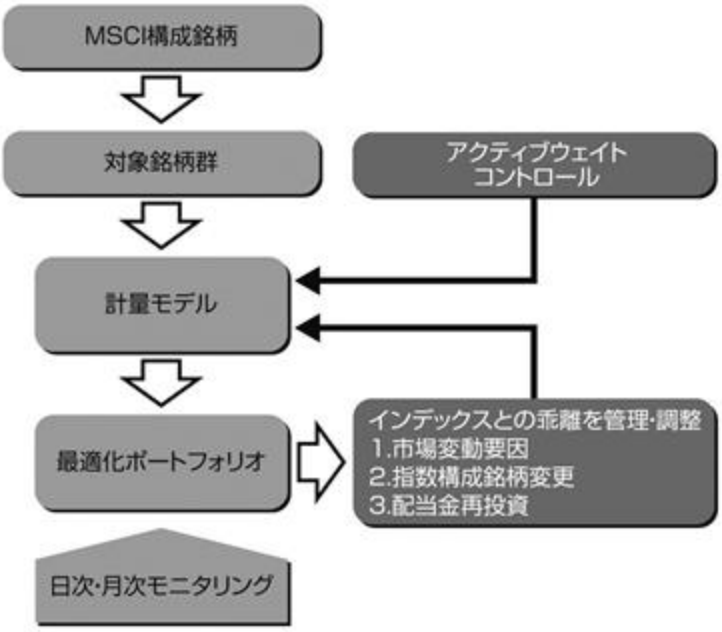
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

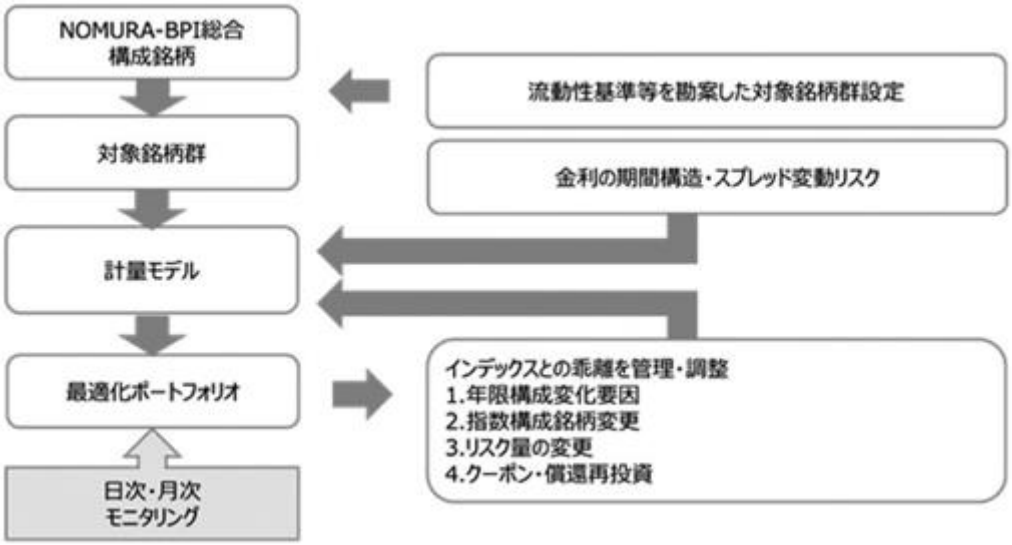
※本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関す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

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

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

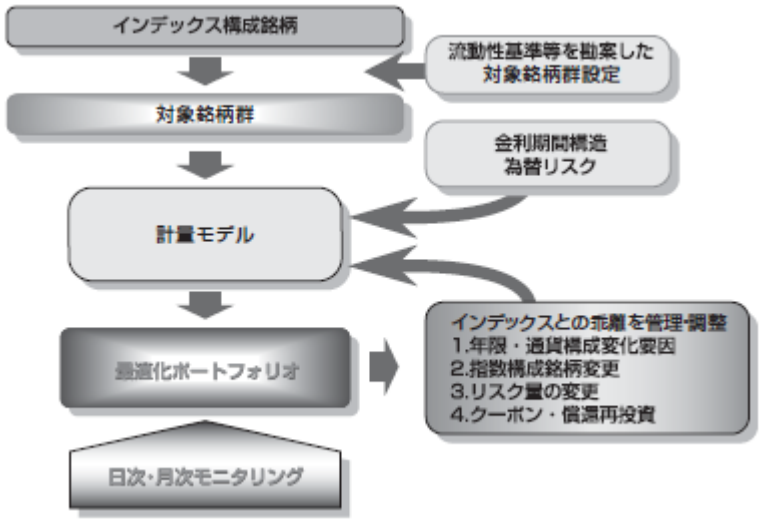
	事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 
主な投資制限	**1.株式への投資割合には、制限を設けません。** **2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。** **3.投資信託証券への投資割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

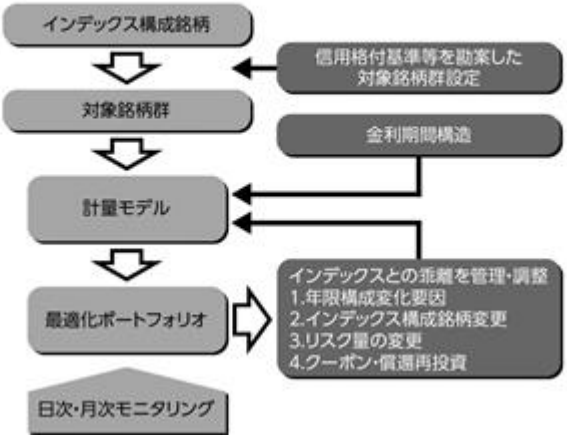
ファンド名	**国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。**
主な投資対象	**わが国の公社債を主要投資対象とします。**

投資態度	1. 主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 ①債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 ②金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 ①、②が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因　・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更　・クーポン、償還再投資 

主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5.外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

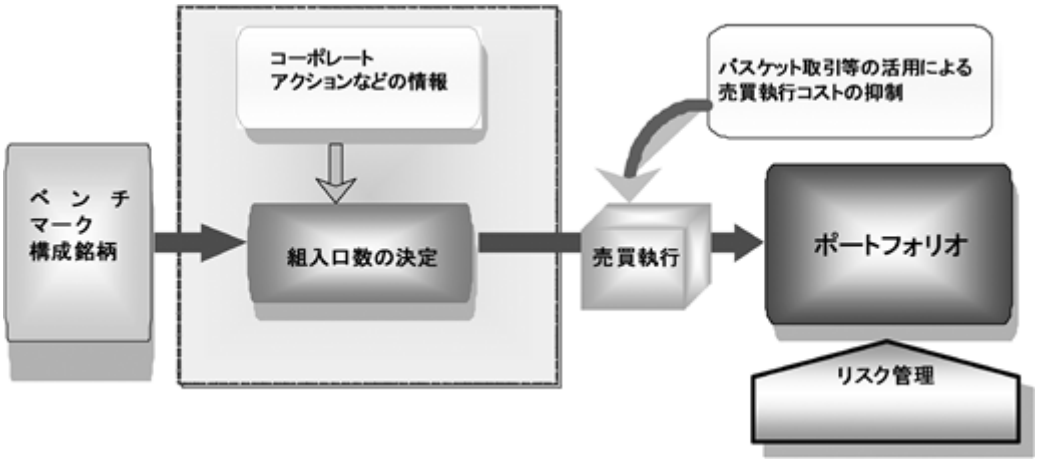
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 ※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。 このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資 
主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

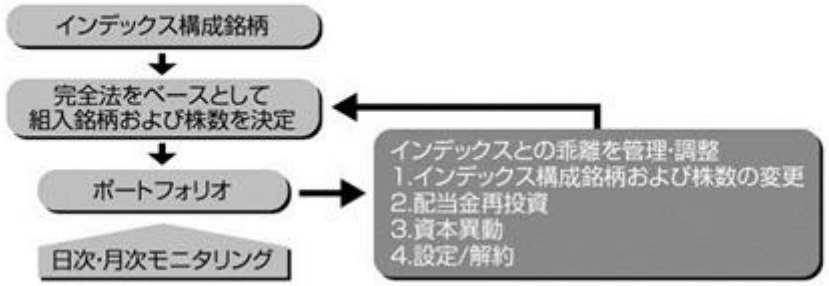
ファンド名	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	1. 東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。 ※①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証ＲＥＩＴ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。 ⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証ＲＥＩＴ指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

ファンド名	**外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。**
主な投資対象	**日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。** **※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。）とします。**

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

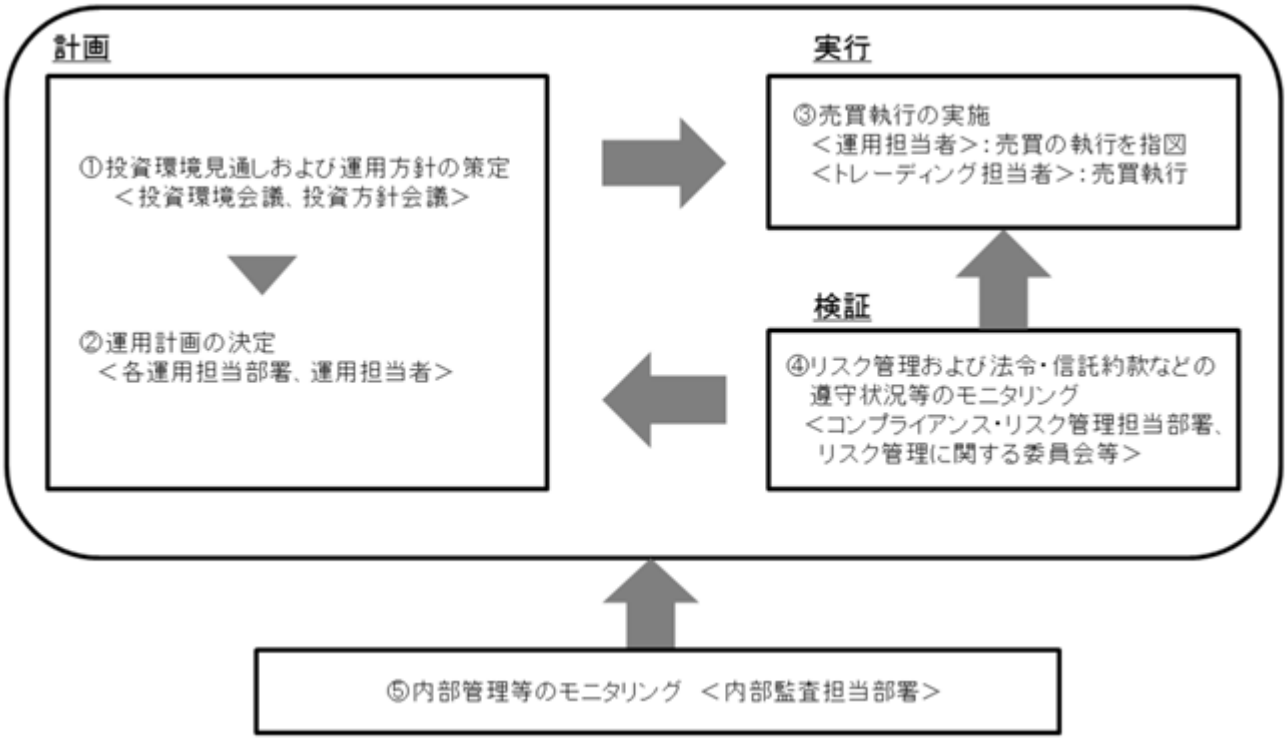
※ＳＡＰ 先進国 ＲＥＩＴインデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスがアセットマネジメントOne株式会社（以下「アセットマネジメントOne」）に付与されています。S&P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJI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 ＲＥＩＴインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに関する、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 ＲＥＩＴ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 ＲＥＩＴ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 ＲＥＩＴインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資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 ＲＥＩＴインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはＳ＆Ｐ 先進国

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

③　売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

④　モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2024年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1）分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2）分配対象額についての分配方針

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

3）留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

ａ.信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1）信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係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係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

係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額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」と言います。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b．上記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係る配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

c．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

収益分配金は、税引後自動的に全額無手数料で再投資されます。

※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決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（５）【投資制限】

①マザーファンド受益証券への投資制限（約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)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。

②株式への実質投資割合（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。

③外貨建資産への実質投資割合（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。

④デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑤外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑦新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（約款第16条第3項）

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑧マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合（約款第16条第5項）

委託会社は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。以下⑧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属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑨投資する株式等の範囲（約款第19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、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等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) 1)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。

⑩同一銘柄の株式への実質投資割合（約款第20条第1項）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑪同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（約款第20条第3項）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑫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い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.から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.から6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り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付社債券の新株予約権(5.に定めるものに限ります。)の行使により取得可能な株券

⑬先物取引等の運用指図（約款第22条）

1）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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。）。

2）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに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係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係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

3）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに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係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

⑭スワップ取引の運用指図（約款第23条）

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

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

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

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

⑮金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

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

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

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

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

⑯デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

⑰有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

1）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1．2．の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

2）上記1）1．2．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3）委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑱特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26条）

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

⑲外国為替予約の指図（約款第27条）

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑳資金の借入れ（約款第33条）

1）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに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。

㉑同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

となる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

○資産配分リスク

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

当ファンドに組入れられている各資産（国内株式、外国株式、国内債券、外国債券、国内リートおよび外国リート）の資産配分比率によっては、収益率の悪い資産への配分が大きくなり、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。また、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。また、新興国の株式に投資する場合、先進国の株式に比べ株価変動リスクが大きくなる傾向があります。

○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。

金利リスクとは、金利の変動を受けて債券・リートの価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券・リートの価格は下落します。当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。新興国の債券に投資する場合、先進国の債券に比べ金利リスクが大きくなる傾向があります。

○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。
当ファンドは、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

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。新興国の通貨に投資する場合、先進国の通貨に比べ為替リスクが大きくなる傾向があります。

○信用リスク

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

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。新興国債券、株式に投資する場合、先進国債券、株式に比べ信用リスクが大きくなる傾向があります。

○流動性リスク

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

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

○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。

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合、または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する場合があります。また、実質的に投資を行う新興国の通貨や有価証券等の発行者が属する国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化などが為替市場や株式、債券市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制などの種々な規制の導入や政策の変更等の要因も為替市場や株式、債券市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

○有価証券（指数）先物取引に伴うリスク

有価証券（指数）先物取引の損失の発生は、基準価額の下落要因です。

当ファンドは、有価証券（指数）先物取引を使用するため、有価証券（指数）先物取引の価格変動により基準価額が上下します。先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下

落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。また、有価証券（指数）先物取引の値動きと市場全体の値動きは一致しない場合があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

○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、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

○当ファンドは、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

○注意事項

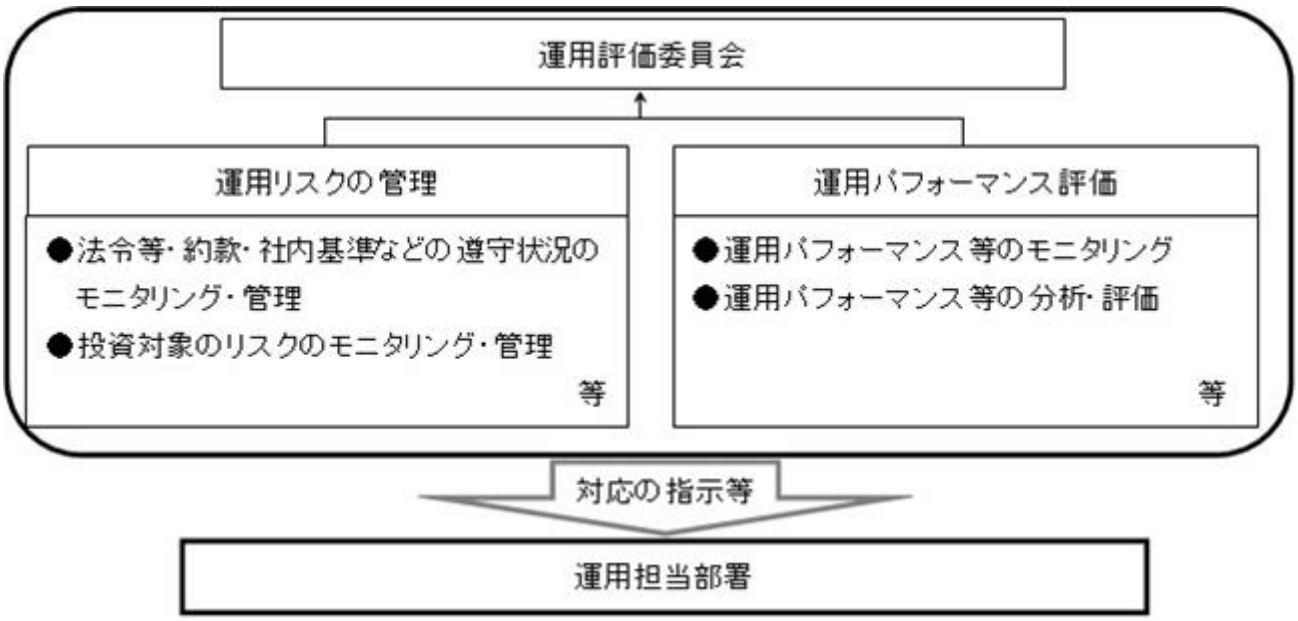
・当ファンドは、実質的に株式、債券、不動産投資信託証券など値動きのある有価証券および値動きのある有価証券（指数）先物（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

＜リスク管理体制＞

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

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



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

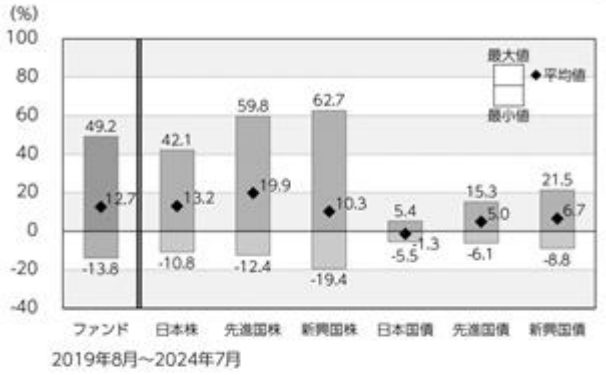
※リスク管理体制は2024年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2019年8月～2024年7月

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.605%（税抜0.55%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.29%	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0.22%	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0.04%	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、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン）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

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額とします。

2.その他の費用

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

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

② 監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

※上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上場不動産投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託（リート）の費用は表示しておりません。
※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。
詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

解約時および償還時の差益（譲渡益）※については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。
原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。
※解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。）を控除した利益。
買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配

当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
当ファンドは、ＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

○法人の受益者に対する課税

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

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は、2024年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。
③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
収益分配の際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

…（参考情報）ファンドの総経費率

総経費率（①+②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.68%	0.61%	0.08%

（表示桁数未満を四捨五入）

※対象期間:2023年1月12日～2024年1月11日
※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。）を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）です。
※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。
※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。
※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		2,159,174,837	97.91
	内　日本	2,159,174,837	97.91
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		46,198,050	2.09
純資産総額		2,205,372,887	100.00

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

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		589,407,997,500	96.79
	内　日本	589,407,997,500	96.79
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		19,578,230,769	3.21
純資産総額		608,986,228,269	100.00

その他資産の投資状況

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）		20,026,520,000	3.29
	内　日本	20,026,520,000	3.29

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		1,508,004,322,906	95.91
	内　アメリカ	1,104,624,290,951	70.25
	内　イギリス	58,508,854,632	3.72
	内　カナダ	50,088,475,592	3.19
	内　スイス	46,968,754,763	2.99
	内　フランス	42,685,132,537	2.71
	内　ドイツ	35,543,602,097	2.26
	内　オランダ	28,324,230,510	1.80
	内　オーストラリア	28,015,595,169	1.78
	内　アイルランド	27,462,949,036	1.75
	内　デンマーク	15,418,999,967	0.98
	内　スウェーデン	13,140,557,486	0.84
	内　スペイン	10,814,968,866	0.69
	内　イタリア	8,846,001,834	0.56
	内　香港	5,557,919,699	0.35
	内　ジャージィー	4,579,344,646	0.29
	内　シンガポール	4,462,194,103	0.28

	内　フィンランド	4,058,846,509	0.26
	内　ベルギー	3,215,829,061	0.20
	内　イスラエル	3,101,602,413	0.20
	内　ノルウェー	2,415,287,452	0.15
	内　ケイマン諸島	1,873,957,643	0.12
	内　バミューダ	1,825,859,994	0.12
	内　オランダ領キュラソー	1,696,458,215	0.11
	内　ニュージーランド	1,041,084,447	0.07
	内　リベリア	947,483,466	0.06
	内　オーストリア	797,739,581	0.05
	内　ルクセンブルグ	759,768,233	0.05
	内　ポルトガル	682,646,482	0.04
	内　パナマ	438,875,052	0.03
	内　マン島	107,012,470	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		2,284,021,380	0.15
	内　オーストラリア	1,912,664,926	0.12
	内　シンガポール	371,356,454	0.02
投資証券		27,688,299,784	1.76
	内　アメリカ	26,167,608,878	1.66
	内　フランス	531,336,994	0.03
	内　イギリス	522,255,590	0.03
	内　香港	262,044,643	0.02
	内　ベルギー	129,195,490	0.01
	内　カナダ	75,858,189	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		34,367,490,257	2.19
純資産総額		1,572,344,134,327	100.00

その他資産の投資状況

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		34,869,724,374	2.22
	内　アメリカ	26,945,561,170	1.71
	内　ドイツ	4,691,529,427	0.30
	内　イギリス	1,427,505,411	0.09
	内　カナダ	1,115,077,029	0.07
	内　オーストラリア	690,051,337	0.04

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		91,221,723,135	94.27
	内　インド	18,581,168,083	19.20
	内　台湾	16,852,277,301	17.42
	内　ケイマン諸島	12,480,578,987	12.90

	内　韓国	11,051,834,951	11.42
	内　中国	8,970,353,895	9.27
	内　ブラジル	3,836,082,432	3.96
	内　サウジアラビア	3,731,386,724	3.86
	内　南アフリカ	2,551,700,180	2.64
	内　インドネシア	1,522,547,057	1.57
	内　メキシコ	1,433,601,584	1.48
	内　マレーシア	1,310,474,479	1.35
	内　タイ	1,274,751,417	1.32
	内　アラブ首長国連邦	1,118,573,464	1.16
	内　ポーランド	774,200,195	0.80
	内　カタール	749,109,430	0.77
	内　トルコ	719,476,348	0.74
	内　香港	710,711,734	0.73
	内　クエート	703,230,480	0.73
	内　フィリピン	499,804,489	0.52
	内　ギリシャ	480,418,271	0.50
	内　チリ	403,326,143	0.42
	内　バミューダ	340,586,282	0.35
	内　アメリカ	253,897,492	0.26
	内　ハンガリー	230,492,393	0.24
	内　イギリス	142,462,232	0.15
	内　チェコ	125,480,618	0.13
	内　ルクセンブルグ	112,421,595	0.12
	内　コロンビア	96,578,210	0.10
	内　エジプト	55,014,705	0.06
	内　オランダ	51,898,373	0.05
	内　ペルー	33,130,309	0.03
	内　シンガポール	24,153,282	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		565,760,046	0.58
	内　メキシコ	423,167,972	0.44
	内　ブラジル	142,592,074	0.15
投資証券		76,535,627	0.08
	内　メキシコ	76,535,627	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,897,919,426	5.06
純資産総額		96,761,938,234	100.00

その他資産の投資状況

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		5,459,611,160	5.64
	内　アメリカ	5,459,611,160	5.64

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		471,075,422,850	85.92
	内　日本	471,075,422,850	85.92
地方債証券		26,650,308,248	4.86
	内　日本	26,650,308,248	4.86
特殊債券		26,022,583,452	4.75
	内　日本	26,022,583,452	4.75
社債券		21,819,309,400	3.98
	内　日本	21,425,609,400	3.91
	内　フランス	393,700,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,732,553,837	0.50
純資産総額		548,300,177,787	100.00

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		255,452,363,537	98.60
	内　アメリカ	120,279,176,428	46.43
	内　中国	25,992,103,239	10.03
	内　フランス	19,575,039,791	7.56
	内　イタリア	18,046,301,705	6.97
	内　ドイツ	15,708,608,401	6.06
	内　イギリス	13,495,757,653	5.21
	内　スペイン	11,878,329,479	4.58
	内　カナダ	5,097,117,943	1.97
	内　ベルギー	4,126,946,985	1.59
	内　オランダ	3,691,566,917	1.42
	内　オーストラリア	3,249,477,641	1.25
	内　オーストリア	2,984,609,503	1.15
	内　メキシコ	1,943,593,291	0.75
	内　ポーランド	1,439,488,339	0.56
	内　フィンランド	1,437,815,088	0.55
	内　アイルランド	1,301,719,366	0.50
	内　マレーシア	1,272,455,204	0.49
	内　シンガポール	1,038,744,541	0.40
	内　イスラエル	786,564,310	0.30
	内　デンマーク	675,878,960	0.26
	内　ニュージーランド	616,455,581	0.24
	内　スウェーデン	415,628,903	0.16
	内　ノルウェー	398,984,269	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,629,591,975	1.40
純資産総額		259,081,955,512	100.00

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		120,943,650,123	97.65
	内　サウジアラビア	14,546,623,488	11.74
	内　メキシコ	11,775,717,896	9.51
	内　ポーランド	10,243,868,338	8.27
	内　アラブ首長国連邦	9,887,486,597	7.98
	内　ブラジル	9,153,866,420	7.39
	内　チリ	7,980,446,576	6.44
	内　ハンガリー	7,608,160,695	6.14
	内　コロンビア	7,255,959,084	5.86
	内　ドミニカ共和国	6,567,762,402	5.30
	内　ルーマニア	6,070,575,244	4.90
	内　カタール	5,267,141,940	4.25
	内　パナマ	5,181,307,155	4.18
	内　南アフリカ	4,960,284,869	4.00
	内　インドネシア	4,038,263,312	3.26
	内　ペルー	3,749,170,582	3.03
	内　オマーン	2,656,221,038	2.14
	内　中国	1,388,914,857	1.12
	内　フィリピン	1,366,230,427	1.10
	内　ウルグアイ	1,245,649,203	1.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,913,566,515	2.35
純資産総額		123,857,216,638	100.00

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		165,382,407,700	97.06
	内　日本	165,382,407,700	97.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,004,217,158	2.94
純資産総額		170,386,624,858	100.00

その他資産の投資状況

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		4,892,612,500	2.87
	内　日本	4,892,612,500	2.87

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		9,605,530,212	10.16
	内　オーストラリア	6,704,395,154	7.09
	内　シンガポール	2,855,411,422	3.02
	内　香港	45,723,636	0.05

投資証券		84,159,271,381	88.98
	内　アメリカ	73,677,503,198	77.90
	内　イギリス	4,506,514,840	4.76
	内　フランス	1,562,417,998	1.65
	内　カナダ	1,322,595,786	1.40
	内　ベルギー	943,882,712	1.00
	内　香港	770,837,949	0.82
	内　スペイン	427,729,241	0.45
	内　ニュージーランド	247,571,424	0.26
	内　ガーンジィ	210,718,278	0.22
	内　韓国	168,652,518	0.18
	内　オランダ	159,706,694	0.17
	内　イスラエル	96,425,207	0.10
	内　ドイツ	31,019,527	0.03
	内　アイルランド	26,832,650	0.03
	内　イタリア	6,863,359	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		812,415,759	0.86
純資産総額		94,577,217,352	100.00

その他資産の投資状況

2024年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		843,188,323	0.89
	内　アメリカ	843,188,323	0.89

（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。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2024年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	111,796,003	7.8271 875,038,498	9.2177 1,030,502,016	－ －	46.73
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	385,770,348	1.5500 597,948,612	1.7742 684,433,751	－ －	31.03
3	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	79,425,412	1.9133 151,967,484	2.1150 167,984,746	－ －	7.62
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	62,340,964	2.2601 140,896,813	2.4273 151,320,221	－ －	6.86

5	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	12,880,508	4.3333 55,815,106	4.9330 63,539,545	－ －	2.88
6	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	17,942,671	2.3013 41,293,122	2.4094 43,231,071	－ －	1.96
7	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,539,059	2.3613 10,718,394	2.2922 10,404,431	－ －	0.47
8	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	6,436,914	1.2456 8,018,001	1.2054 7,759,056	－ －	0.35

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.91
合計	97.91

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,960,800	3,277.39 26,090,711,381	2,949.00 23,476,399,200	－ －	3.85
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,982,700	1,410.79 12,672,736,268	1,750.00 15,719,725,000	－ －	2.58
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,048,800	14,229.36 14,923,756,514	13,530.00 14,190,264,000	－ －	2.33
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,634,500	2,363.00 8,588,327,662	3,288.00 11,950,236,000	－ －	1.96
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,032,900	7,740.40 7,995,068,336	10,915.00 11,274,103,500	－ －	1.85
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	149,800	64,303.96 9,632,733,796	65,890.00 9,870,322,000	－ －	1.62
7	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	317,000	28,852.79 9,146,337,210	31,020.00 9,833,340,000	－ －	1.61
8	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,108,800	5,813.19 6,445,674,522	8,658.00 9,599,990,400	－ －	1.58

9	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,042,500	2,816.79 8,570,094,402	3,144.00 9,565,620,000	－ －	1.57
10	信越化学工業 日本	株式 化学	1,345,200	5,840.31 7,856,387,409	6,748.00 9,077,409,600	－ －	1.49
11	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,440,100	3,910.84 5,632,011,283	6,022.00 8,672,282,200	－ －	1.42
12	三井物産 日本	株式 卸売業	2,373,400	2,955.47 7,014,533,783	3,530.00 8,378,102,000	－ －	1.38
13	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,065,200	6,739.03 7,178,424,359	7,783.00 8,290,451,600	－ －	1.36
14	第一三共 日本	株式 医薬品	1,308,500	4,525.05 5,921,038,853	6,148.00 8,044,658,000	－ －	1.32
15	任天堂 日本	株式 その他製品	945,600	8,341.60 7,887,823,710	8,388.00 7,931,692,800	－ －	1.30
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	44,678,600	182.90 8,171,998,709	160.40 7,166,447,440	－ －	1.18
17	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,991,000	2,732.41 5,440,231,014	3,448.00 6,864,968,000	－ －	1.13
18	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	741,000	6,697.29 4,962,696,056	9,162.00 6,789,042,000	－ －	1.11
19	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,548,500	1,715.78 6,088,456,979	1,647.00 5,844,379,500	－ －	0.96
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,329,400	4,214.87 5,603,255,242	4,302.00 5,719,078,800	－ －	0.94
21	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	294,900	18,371.67 5,417,807,769	18,940.00 5,585,406,000	－ －	0.92
22	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,104,700	4,589.54 5,070,070,774	4,520.00 4,993,244,000	－ －	0.82
23	三菱重工業 日本	株式 機械	2,645,200	1,050.14 2,777,837,439	1,830.00 4,840,716,000	－ －	0.79
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,399,800	1,943.19 4,663,288,557	1,965.00 4,715,607,000	－ －	0.77
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,337,700	2,979.82 3,986,109,136	3,351.00 4,482,632,700	－ －	0.74
26	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,656,800	2,033.97 3,369,884,148	2,601.00 4,309,336,800	－ －	0.71
27	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	896,100	3,947.79 3,537,617,692	4,434.00 3,973,307,400	－ －	0.65
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	180,500	21,133.74 3,814,640,096	21,905.00 3,953,852,500	－ －	0.65
29	富士通 日本	株式 電気機器	1,391,900	2,306.64 3,210,616,734	2,732.50 3,803,366,750	－ －	0.62
30	丸紅 日本	株式 卸売業	1,314,400	2,398.68 3,152,830,415	2,860.50 3,759,841,200	－ －	0.62

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.79
合計	96.79

（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。

投資株式の業種別投資比率

2024年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	16.65
銀行業		8.07
輸送用機器		7.52
卸売業		7.29
情報・通信業		6.93
化学		5.55
機械		5.34
医薬品		4.66
サービス業		4.41
小売業		3.90
保険業		3.19
食料品		3.12
その他製品		2.35
陸運業		2.22
精密機器		2.19
建設業		2.07
不動産業		1.95
電気・ガス業		1.34
その他金融業		1.17
証券、商品先物取引業		0.92
鉄鋼		0.83
海運業		0.73
非鉄金属		0.71
ガラス・土石製品		0.66
ゴム製品		0.61
金属製品		0.52
石油・石炭製品		0.51
繊維製品		0.36
空運業		0.34
鉱業		0.30
パルプ・紙		0.14
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業		0.08
合計		96.79

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	2,370,279	28,215.21 66,877,938,474	33,353.87 79,057,982,370	－ －	5.03
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,140,439	62,604.79 71,396,951,436	64,469.92 73,524,016,568	－ －	4.68
3	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	4,039,878	11,625.03 46,963,722,239	15,812.60 63,880,979,710	－ －	4.06
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	1,513,035	26,192.20 39,629,719,453	27,699.87 41,910,876,436	－ －	2.67
5	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	354,138	72,306.78 25,606,580,467	70,608.68 25,005,217,992	－ －	1.59
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	954,753	22,451.33 21,435,479,861	25,959.00 24,784,440,383	－ －	1.58
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	822,547	22,609.32 18,597,235,597	26,198.33 21,549,364,655	－ －	1.37
8	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	130,668	116,063.36 15,165,767,644	120,459.61 15,740,216,633	－ －	1.00
9	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	463,451	28,828.59 13,360,641,289	33,936.19 15,727,762,489	－ －	1.00
10	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	711,840	19,442.21 13,839,749,369	21,878.18 15,573,769,915	－ －	0.99
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	464,279	26,995.81 12,533,589,805	32,803.56 15,230,005,704	－ －	0.97

12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	211,732	60,875.22 12,889,232,240	67,265.67 14,242,295,772	－ －	0.91
13	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	149,263	78,647.25 11,739,125,863	87,855.74 13,113,612,095	－ －	0.83
14	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	725,341	15,406.16 11,174,722,185	18,013.83 13,066,172,947	－ －	0.83
15	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	527,758	18,820.81 9,932,838,080	19,810.43 10,455,118,193	－ －	0.66
16	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	255,530	42,275.51 10,802,663,153	40,106.96 10,248,532,510	－ －	0.65
17	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	390,048	23,686.96 9,239,055,158	24,593.14 9,592,507,098	－ －	0.61
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	380,193	23,799.84 9,048,533,745	24,649.54 9,371,585,602	－ －	0.60
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	134,412	70,821.87 9,519,309,505	68,209.27 9,168,145,474	－ －	0.58
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	160,510	54,481.19 8,744,776,929	55,440.90 8,898,819,436	－ －	0.57
21	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	71,768	110,906.80 7,959,559,474	123,480.97 8,861,982,484	－ －	0.56
22	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	64,662	141,253.96 9,133,764,013	132,851.87 8,590,467,811	－ －	0.55
23	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	286,271	26,512.01 7,589,622,068	28,472.74 8,150,920,668	－ －	0.52
24	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	716,767	8,637.58 6,191,138,644	10,547.32 7,559,973,494	－ －	0.48
25	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,150,276	5,099.20 5,865,493,683	6,292.72 7,238,368,471	－ －	0.46
26	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	410,297	19,195.00 7,875,651,143	17,568.70 7,208,389,006	－ －	0.46

27	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	283,787	23,043.52 6,539,451,765	24,324.85 6,903,076,433	－ －	0.44
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	661,895	9,063.29 5,998,946,522	10,317.13 6,828,862,850	－ －	0.43
29	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	70,128	88,743.01 6,223,370,003	94,906.09 6,655,574,644	－ －	0.42
30	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	432,036	16,709.82 7,219,246,545	15,328.33 6,622,393,836	－ －	0.42

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.91
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.15
投資証券	1.76
合計	97.81

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	8.40
半導体・半導体製造装置		8.38
銀行		5.66
コンピュータ・周辺機器		5.37
医薬品		4.96
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.66
石油・ガス・消耗燃料		4.18
資本市場		3.22
大規模小売り		3.08
保険		3.02
金融サービス		2.95
ヘルスケア機器・用品		2.06
航空宇宙・防衛		2.02
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.98
バイオテクノロジー		1.84
ホテル・レストラン・レジャー		1.78
機械		1.76
生活必需品流通・小売り		1.72
化学		1.71
電力		1.60
専門小売り		1.58
自動車		1.53
飲料		1.39
金属・鉱業		1.27
情報技術サービス		1.20
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.20

食品	1.17
電気設備	1.01
娯楽	1.00
陸上運輸	0.99
家庭用品	0.97
専門サービス	0.97
繊維・アパレル・贅沢品	0.95
各種電気通信サービス	0.90
総合公益事業	0.71
建設関連製品	0.65
通信機器	0.64
コングロマリット	0.62
商業サービス・用品	0.61
パーソナルケア用品	0.56
タバコ	0.56
メディア	0.56
電子装置・機器・部品	0.48
商社・流通業	0.47
消費者金融	0.43
航空貨物・物流サービス	0.43
家庭用耐久財	0.34
建設・土木	0.33
建設資材	0.33
不動産管理・開発	0.28
エネルギー設備・サービス	0.23
無線通信サービス	0.21
容器・包装	0.21
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12
自動車用部品	0.10
運送インフラ	0.09
水道	0.09
販売	0.08
ガス	0.08
紙製品・林産品	0.08
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	95.91

（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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

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

1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,989,940	3,730.61 7,423,702,680	4,359.15 8,674,458,890	－ －	8.96
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	5,898.76 3,150,530,542	6,898.73 3,684,614,897	－ －	3.81
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	385,943	8,702.37 3,358,621,594	8,950.49 3,454,382,821	－ －	3.57
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小売り	1,258,968	1,326.67 1,670,247,666	1,486.66 1,871,659,884	－ －	1.93
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	245,849	5,361.26 1,318,061,811	5,538.12 1,361,543,476	－ －	1.41
6	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	419,311	1,955.66 820,031,487	2,213.29 928,058,310	－ －	0.96
7	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	268,642	2,588.31 695,331,001	3,435.18 922,834,834	－ －	0.95
8	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	44,109	19,775.73 872,287,720	20,873.44 920,707,006	－ －	0.95
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,008,195	682.32 687,915,224	908.93 916,379,084	－ －	0.95
10	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小売り	48,325	17,437.01 842,643,731	18,774.51 907,278,215	－ －	0.94
11	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・レストラン・レジャー	410,610	1,906.98 783,028,452	2,075.86 852,370,517	－ －	0.88
12	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,748,530	93.69 725,988,665	105.93 820,873,844	－ －	0.85
13	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	122,945	4,890.72 601,289,837	5,819.93 715,532,154	－ －	0.74

14	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	226,901	2,762.64 626,847,837	2,956.45 670,822,936	－ －	0.69
15	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	73,032	7,080.72 517,119,550	7,988.59 583,422,741	－ －	0.60
16	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	158,927	3,269.43 519,601,741	3,459.49 549,807,956	－ －	0.57
17	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信サービス	183,172	2,239.66 410,243,488	2,690.74 492,868,318	－ －	0.51
18	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	66,036	7,307.56 482,562,658	6,961.50 459,709,614	－ －	0.48
19	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	275,289	1,686.39 464,246,184	1,634.25 449,891,147	－ －	0.46
20	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,252,235	78.64 413,087,024	84.28 442,675,172	－ －	0.46
21	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	156,600	2,751.23 430,843,192	2,782.12 435,680,931	－ －	0.45
22	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,371,200	64.24 409,291,123	67.11 427,599,265	－ －	0.44
23	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	4,463,000	89.45 399,240,490	95.64 426,863,635	－ －	0.44
24	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小売り	14,368	26,636.14 382,708,162	28,874.31 414,866,091	－ －	0.43
25	MAHINDRA & MAHINDRA LTD インド	株式 自動車	75,480	3,737.67 282,119,666	5,347.44 403,624,997	－ －	0.42
26	AXIS BANK LTD インド	株式 銀行	184,556	1,931.32 356,437,209	2,141.09 395,152,851	－ －	0.41
27	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	1,238,800	318.05 394,003,927	318.40 394,437,884	－ －	0.41
28	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	384,212	1,079.13 414,617,176	994.60 382,140,213	－ －	0.39
29	LARSEN & TOUBRO LTD インド	株式 建設・土木	54,568	6,489.51 354,120,113	6,925.90 377,933,029	－ －	0.39
30	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小売り	188,535	1,931.98 364,247,135	1,993.92 375,924,084	－ －	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7月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	94.27
投資信託受益証券	0.58
投資証券	0.08
合計	94.94

（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7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	16.06
半導体・半導体製造装置		12.04
コンピュータ・周辺機器		5.82
石油・ガス・消耗燃料		4.84
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.76
大規模小売り		3.98
金属・鉱業		3.53
自動車		3.10
保険		2.60
電子装置・機器・部品		2.58
情報技術サービス		2.39
ホテル・レストラン・レジャー		2.02
化学		1.98
電気設備		1.52
無線通信サービス		1.43
食品		1.42
不動産管理・開発		1.33
医薬品		1.25
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		1.24
生活必需品流通・小売り		1.24
金融サービス		1.17
各種電気通信サービス		1.16
コングロマリット		1.13
電力		1.10
飲料		0.94
娯楽		0.89
バイオテクノロジー		0.79
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		0.73
パーソナルケア用品		0.71
機械		0.70
運送インフラ		0.70
建設資材		0.68
繊維・アパレル・贅沢品		0.68
建設・土木		0.67
消費者金融		0.66
資本市場		0.66
自動車用部品		0.66

専門小売り	0.61
航空宇宙・防衛	0.54
旅客航空輸送	0.37
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.36
タバコ	0.34
ガス	0.34
家庭用耐久財	0.33
海上運輸	0.30
陸上運輸	0.23
航空貨物・物流サービス	0.22
通信機器	0.20
各種消費者サービス	0.19
ソフトウェア	0.16
ヘルスケア機器・用品	0.15
紙製品・林産品	0.14
商社・流通業	0.14
水道	0.12
総合公益事業	0.10
メディア	0.06
建設関連製品	0.05
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	94.27

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	１４５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	7,300,000,000	100.04 7,303,431,000	99.76 7,282,626,000	0.1 2025/9/20	1.33
2	１６３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	6,800,000,000	99.65 6,776,740,000	99.21 6,746,416,000	0.4 2028/9/20	1.23
3	３７３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	6,400,000,000	97.66 6,250,804,000	96.40 6,169,728,000	0.6 2033/12/20	1.13
4	１５６回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	6,100,000,000	99.27 6,055,670,000	98.91 6,033,998,000	0.2 2027/12/20	1.10
5	３７４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,600,000,000	97.94 5,484,951,500	97.89 5,482,288,000	0.8 2034/3/20	1.00
6	１１３回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	4,970,000,000	108.09 5,372,396,400	107.23 5,329,529,800	2.1 2029/9/20	0.97

7	１５３回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,210,000,000	99.41 5,179,677,800	98.63 5,138,831,400	0.005 2027/6/20	0.94
8	３７２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,200,000,000	100.50 5,226,181,000	98.44 5,119,348,000	0.8 2033/9/20	0.93
9	１５１回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	5,000,000,000	99.15 4,957,928,000	98.79 4,939,500,000	0.005 2027/3/20	0.90
10	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,950,000,000	99.00 4,900,648,500	98.02 4,852,039,500	0.1 2028/9/20	0.88
11	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,890,000,000	99.90 4,885,110,000	99.16 4,848,972,900	0.1 2026/12/20	0.88
12	１５７回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,900,000,000	99.02 4,852,278,000	98.77 4,839,730,000	0.2 2028/3/20	0.88
13	１４１回　利付国庫債券 （２０年） 日本	国債証券	4,460,000,000	107.01 4,772,777,800	106.36 4,743,745,200	1.7 2032/12/20	0.87
14	１４６回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,700,000,000	99.99 4,699,530,000	99.68 4,685,383,000	0.1 2025/12/20	0.85
15	４５３回　利付国庫債券 （２年） 日本	国債証券	4,700,000,000	99.77 4,689,425,000	99.68 4,684,960,000	0.005 2025/10/1	0.85
16	３７１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,800,000,000	96.82 4,647,695,000	95.29 4,574,304,000	0.4 2033/6/20	0.83
17	１４８回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,610,000,000	99.68 4,595,515,900	99.20 4,573,350,500	0.005 2026/6/20	0.83
18	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,540,000,000	99.84 4,533,008,400	99.03 4,496,279,800	0.1 2027/3/20	0.82
19	３６８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,750,000,000	96.37 4,577,860,000	94.62 4,494,497,500	0.2 2032/9/20	0.82
20	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,500,000,000	99.73 4,488,030,000	98.90 4,450,680,000	0.1 2027/6/20	0.81
21	４６１回　利付国庫債券 （２年） 日本	国債証券	4,400,000,000	100.12 4,405,305,000	99.96 4,398,372,000	0.4 2026/6/1	0.80
22	４６０回　利付国庫債券 （２年） 日本	国債証券	4,300,000,000	99.96 4,298,323,000	99.81 4,292,131,000	0.3 2026/5/1	0.78
23	１５８回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,100,000,000	99.27 4,070,337,000	98.41 4,034,974,000	0.1 2028/3/20	0.74

24	３６５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,230,000,000	96.31 4,073,981,000	94.85 4,012,281,900	0.1 2031/12/20	0.73
25	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,100,000,000	97.82 4,010,661,000	96.32 3,949,407,000	0.1 2030/9/20	0.72
26	１４４回　利付国庫債券 （２０年） 日本	国債証券	3,750,000,000	105.18 3,944,467,500	104.72 3,927,075,000	1.5 2033/3/20	0.72
27	３５９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,050,000,000	98.05 3,971,146,500	96.55 3,910,437,000	0.1 2030/6/20	0.71
28	１５４回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	3,900,000,000	99.43 3,878,084,000	98.74 3,851,211,000	0.1 2027/9/20	0.70
29	３６１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,000,000,000	97.57 3,903,124,000	96.06 3,842,680,000	0.1 2030/12/20	0.70
30	３６２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,010,000,000	97.32 3,902,532,000	95.80 3,841,660,200	0.1 2031/3/20	0.70

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	85.92
地方債証券	4.86
特殊債券	4.75
社債券	3.98
合計	99.50

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,310,984,000	98.75 1,294,666,695	100.12 1,312,648,327	4.125 2032/11/15	0.51
2	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	1,362,813,600	92.01 1,254,006,396	93.55 1,274,976,008	1.5 2027/1/31	0.49
3	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,332,325,600	83.71 1,115,380,313	85.61 1,140,621,635	1.625 2031/5/15	0.44
4	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,227,142,000	90.24 1,107,423,755	91.87 1,127,388,779	2.875 2032/5/15	0.44
5	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,355,191,600	81.03 1,098,165,551	82.99 1,124,782,555	1.375 2031/11/15	0.43

6	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,324,703,600	81.48 1,079,478,033	83.39 1,104,756,222	1.125 2031/2/15	0.43
7	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,067,080,000	100.86 1,076,288,662	102.74 1,096,341,339	4.5 2033/11/15	0.42
8	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,323,179,200	80.42 1,064,202,194	82.52 1,091,984,647	0.875 2030/11/15	0.42
9	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,195,129,600	89.08 1,064,692,413	90.76 1,084,720,166	2.75 2032/8/15	0.42
10	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証券	1,052,945,000	100.02 1,053,207,058	101.09 1,064,434,735	2.18 2026/8/15	0.41
11	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	1,031,886,100	101.94 1,051,966,883	102.43 1,057,054,524	3.03 2026/3/11	0.41
12	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証券	1,042,415,550	100.31 1,045,685,998	101.28 1,055,796,204	2.3 2026/5/15	0.41
13	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,105,190,000	94.12 1,040,283,461	95.49 1,055,434,861	3.5 2033/2/15	0.41
14	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,274,398,400	80.82 1,030,028,764	82.80 1,055,286,505	1.25 2031/8/15	0.41
15	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,067,080,000	96.78 1,032,732,981	98.00 1,045,800,920	3.875 2033/8/15	0.40
16	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,216,471,200	83.41 1,014,744,715	85.67 1,042,221,199	1.875 2032/2/15	0.40
17	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証券	981,344,740	101.31 994,272,676	102.17 1,002,728,732	2.69 2026/8/12	0.39
18	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	960,285,840	101.61 975,755,109	103.69 995,806,237	2.68 2030/5/21	0.38
19	US T N/B 2.875 05/15/52 アメリカ	国債証券	1,297,264,400	73.24 950,223,617	74.97 972,618,910	2.875 2052/5/15	0.38
20	US T N/B 4.0 02/29/28 アメリカ	国債証券	945,128,000	98.88 934,633,582	99.61 941,473,010	4 2028/2/29	0.36
21	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証券	914,640,000	98.40 900,062,925	98.82 903,850,101	3.75 2026/4/15	0.35
22	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証券	914,640,000	92.22 843,505,299	93.83 858,243,148	0.75 2026/4/30	0.33
23	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 中国	国債証券	821,297,100	103.05 846,425,229	104.42 857,658,879	3.01 2028/5/13	0.33
24	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27 中国	国債証券	829,931,249	101.03 838,501,140	102.19 848,132,720	2.5 2027/7/25	0.33
25	US T N/B 1.0 07/31/28 アメリカ	国債証券	955,798,800	86.83 829,939,508	88.69 847,767,402	1 2028/7/31	0.33
26	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,027,445,600	79.50 816,819,252	81.75 840,017,039	0.625 2030/8/15	0.32
27	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	871,956,800	92.49 806,525,980	94.05 820,133,274	0.75 2026/3/31	0.32

28	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	868,908,000	92.22 801,347,003	93.98 816,654,721	0.375 2026/1/31	0.32
29	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証券	858,237,200	91.97 789,326,784	93.58 803,206,093	0.75 2026/5/31	0.31
30	FRANCE OAT 0.5 05/25/26 フランス	国債証券	834,343,400	95.00 792,682,938	95.99 800,969,245	0.5 2026/5/25	0.31

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.60
合計	98.60

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	2,134,160,000	100.85 2,152,386,336	103.30 2,204,633,164	5.5 2032/10/25	1.78
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	2,134,160,000	96.51 2,059,869,890	98.14 2,094,484,898	4.375 2029/4/16	1.69
3	HUNGARY 5.25 06/16/29 ハンガリー	国債証券	1,981,720,000	97.45 1,931,186,140	99.58 1,973,508,743	5.25 2029/6/16	1.59
4	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,829,280,000	103.68 1,896,665,187	106.87 1,954,985,835	7.125 2033/1/17	1.58
5	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証券	1,829,280,000	101.06 1,848,670,368	103.87 1,900,073,136	6.25 2032/9/22	1.53
6	BRAZIL 3.75 09/12/31 ブラジル	国債証券	2,134,160,000	84.61 1,805,831,883	86.80 1,852,558,825	3.75 2031/9/12	1.50
7	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,981,720,000	88.96 1,762,975,764	93.31 1,849,192,475	4.85 2029/9/30	1.49
8	REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34 ポーランド	国債証券	1,676,840,000	97.39 1,633,223,867	100.08 1,678,282,082	5.125 2034/9/18	1.36
9	REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33 ポーランド	国債証券	1,676,840,000	96.16 1,612,557,271	99.02 1,660,440,504	4.875 2033/10/4	1.34
10	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33 サウジアラビア	国債証券	1,676,840,000	96.06 1,610,852,230	98.71 1,655,364,710	4.875 2033/7/18	1.34

11	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	2,134,160,000	70.61 1,507,086,169	77.01 1,643,687,348	5.75 2049/9/30	1.33
12	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,981,720,000	77.71 1,540,051,014	80.60 1,597,272,265	2.125 2031/9/22	1.29
13	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	1,524,400,000	100.93 1,538,601,310	102.94 1,569,221,171	6 2029/8/1	1.27
14	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,524,400,000	100.06 1,525,442,249	102.53 1,563,038,341	6.35 2035/2/9	1.26
15	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証券	1,707,328,000	88.74 1,515,103,751	91.10 1,555,497,455	3.25 2030/10/22	1.26
16	REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29 ポーランド	国債証券	1,524,400,000	98.31 1,498,643,737	99.91 1,523,098,162	4.625 2029/3/18	1.23
17	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28 サウジアラビア	国債証券	1,524,400,000	98.33 1,498,962,642	99.82 1,521,660,653	4.75 2028/1/18	1.23
18	REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53 ポーランド	国債証券	1,524,400,000	95.77 1,459,978,856	98.32 1,498,893,739	5.5 2053/4/4	1.21
19	BRAZIL 6.0 10/20/33 ブラジル	国債証券	1,524,400,000	95.43 1,454,877,314	98.15 1,496,207,060	6 2033/10/20	1.21
20	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33 サウジアラビア	国債証券	1,829,280,000	77.96 1,426,170,712	80.67 1,475,792,219	2.25 2033/2/2	1.19
21	COLOMBIA 3.125 04/15/31 コロンビア	国債証券	1,829,280,000	78.04 1,427,665,399	80.44 1,471,561,424	3.125 2031/4/15	1.19
22	BRAZIL 4.5 05/30/29 ブラジル	国債証券	1,524,400,000	93.14 1,419,932,258	96.01 1,463,667,477	4.5 2029/5/30	1.18
23	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,676,840,000	84.06 1,409,557,966	86.63 1,452,697,903	2.783 2031/1/23	1.17
24	REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32 ポーランド	国債証券	1,371,960,000	102.34 1,404,094,352	105.28 1,444,403,603	5.75 2032/11/16	1.17
25	HUNGARY 6.125 05/22/28 ハンガリー	国債証券	1,371,960,000	101.49 1,392,508,302	102.63 1,408,092,281	6.125 2028/5/22	1.14
26	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	1,524,400,000	84.37 1,286,212,500	92.33 1,407,498,718	7.3 2052/4/20	1.14
27	REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34 チリ	国債証券	1,554,888,000	85.34 1,326,989,370	88.30 1,373,048,606	3.5 2034/1/31	1.11
28	INDONESIA 3.85 10/15/30 インドネシア	国債証券	1,432,936,000	92.09 1,319,614,555	94.19 1,349,743,318	3.85 2030/10/15	1.09
29	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	1,371,960,000	94.97 1,302,969,924	97.91 1,343,355,621	5.5 2029/2/22	1.08

30	REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54 ポーランド	国債証券	1,371,960,000	95.83 1,314,845,305	97.81 1,341,985,417	5.5 2054/3/18	1.08

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.65
合計	97.65

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	19,399	586,578.78 11,379,041,794	579,000.00 11,232,021,000	－ －	6.59
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	17,081	520,798.80 8,895,764,315	520,000.00 8,882,120,000	－ －	5.21
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	53,775	141,248.16 7,595,620,105	147,700.00 7,942,567,500	－ －	4.66
4	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	83,777	90,746.56 7,602,475,218	93,600.00 7,841,527,200	－ －	4.60
5	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	55,857	132,853.31 7,420,787,755	131,400.00 7,339,609,800	－ －	4.31
6	ＫＤＸ不動産投資法人 日本	投資証券	46,523	152,539.56 7,096,598,327	154,600.00 7,192,455,800	－ －	4.22
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	28,969	249,204.21 7,219,196,831	247,100.00 7,158,239,900	－ －	4.20
8	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	91,623	68,066.17 6,236,427,089	68,100.00 6,239,526,300	－ －	3.66
9	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	25,066	253,205.71 6,346,854,574	242,100.00 6,068,478,600	－ －	3.56
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	37,198	141,833.41 5,275,919,535	143,400.00 5,334,193,200	－ －	3.13
11	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	33,134	159,857.78 5,296,727,767	156,100.00 5,172,217,400	－ －	3.04
12	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	16,343	327,868.83 5,358,360,360	315,000.00 5,148,045,000	－ －	3.02

13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	61,089	78,915.43 4,820,864,810	76,800.00 4,691,635,200	－ －	2.75
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	49,969	80,081.82 4,001,608,583	79,300.00 3,962,541,700	－ －	2.33
15	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	30,447	125,303.51 3,815,116,092	123,600.00 3,763,249,200	－ －	2.21
16	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	11,373	331,332.48 3,768,244,300	326,500.00 3,713,284,500	－ －	2.18
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	5,742	649,665.38 3,730,378,655	642,000.00 3,686,364,000	－ －	2.16
18	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	21,304	151,000.17 3,216,907,754	148,200.00 3,157,252,800	－ －	1.85
19	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	6,934	442,713.15 3,069,773,040	422,500.00 2,929,615,000	－ －	1.72
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	11,173	272,667.95 3,046,519,007	256,200.00 2,862,522,600	－ －	1.68
21	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	8,083	375,267.99 3,033,291,178	353,500.00 2,857,340,500	－ －	1.68
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,170	452,628.99 2,792,720,880	434,500.00 2,680,865,000	－ －	1.57
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	20,398	133,773.92 2,728,720,582	129,600.00 2,643,580,800	－ －	1.55
24	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,188	323,269.56 2,646,931,229	311,500.00 2,550,562,000	－ －	1.50
25	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	19,555	130,416.51 2,550,294,938	128,600.00 2,514,773,000	－ －	1.48
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	24,560	104,067.85 2,555,906,592	101,900.00 2,502,664,000	－ －	1.47
27	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	32,053	70,374.87 2,255,726,026	69,800.00 2,237,299,400	－ －	1.31
28	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	5,742	386,801.73 2,221,015,590	378,500.00 2,173,347,000	－ －	1.28
29	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	14,694	146,742.53 2,156,234,848	142,700.00 2,096,833,800	－ －	1.23
30	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	6,890	281,047.94 1,936,420,324	293,400.00 2,021,526,000	－ －	1.19

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.06
合計	97.06

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率（%）
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	398,189	16,777.02 6,680,426,690	19,221.15 7,653,654,319	－ －	8.09
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	40,775	116,621.53 4,755,243,065	117,191.29 4,778,475,208	－ －	5.05
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	256,899	15,658.54 4,022,664,686	17,109.86 4,395,507,362	－ －	4.65
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	374,194	8,124.58 3,040,169,437	8,897.92 3,329,549,324	－ －	3.52
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	140,066	22,326.21 3,127,143,347	23,599.23 3,305,450,645	－ －	3.49
6	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	67,966	44,391.09 3,017,084,992	46,398.16 3,153,497,532	－ －	3.33
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	139,451	22,628.32 3,155,542,712	22,109.89 3,083,247,330	－ －	3.26
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	742,819	3,566.54 2,649,299,309	3,492.73 2,594,468,062	－ －	2.74
9	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	91,013	24,227.53 2,205,020,240	24,862.96 2,262,852,942	－ －	2.39
10	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	448,461	4,296.64 1,926,876,921	4,789.66 2,147,977,865	－ －	2.27
11	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	126,034	13,610.76 1,715,419,524	15,440.64 1,946,046,579	－ －	2.06
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	61,049	31,097.22 1,898,454,512	31,423.98 1,918,402,652	－ －	2.03
13	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	148,309	10,426.75 1,546,381,639	10,605.25 1,572,854,140	－ －	1.66
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	174,102	7,711.95 1,342,667,376	8,362.85 1,455,990,373	－ －	1.54
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	247,708	5,396.08 1,336,653,845	5,333.87 1,321,243,657	－ －	1.40
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	67,719	17,791.26 1,204,806,754	18,143.40 1,228,653,500	－ －	1.30
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	27,626	42,424.31 1,172,014,223	42,805.15 1,182,535,129	－ －	1.25
18	MID AMERICA アメリカ	投資証券	50,275	21,497.01 1,080,762,275	21,541.29 1,082,988,676	－ －	1.15

19	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	53,644	17,960.24 963,459,535	19,396.46 1,040,504,000	－ －	1.10
20	SEGRO PLC イギリス	投資証券	575,957	1,749.37 1,007,564,898	1,787.28 1,029,401,495	－ －	1.09
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	302,944	2,949.67 893,585,622	3,329.28 1,008,588,308	－ －	1.07
22	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	287,311	2,908.68 835,696,863	3,358.25 964,863,085	－ －	1.02
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	116,896	6,790.60 793,794,810	7,660.10 895,436,218	－ －	0.95
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	94,222	8,434.34 794,701,052	9,268.35 873,282,662	－ －	0.92
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	80,313	9,822.68 788,889,096	10,449.76 839,251,735	－ －	0.89
26	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	303,636	2,785.76 845,857,347	2,713.43 823,895,638	－ －	0.87
27	UDR INC アメリカ	投資証券	130,468	6,211.87 810,450,386	6,227.17 812,446,937	－ －	0.86
28	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	45,884	16,735.81 767,906,355	17,041.26 781,921,522	－ －	0.83
29	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	138,621	5,541.23 768,131,115	5,509.18 763,688,262	－ －	0.81
30	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,237,692	318.43 712,553,820	338.80 758,152,426	－ －	0.80

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.16
投資証券	88.98
合計	99.14

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０６０９月	買建	716	19,879,061,280	20,026,520,000	3.29

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep24	買建	646	27,439,247,637	26,945,561,170	1.71
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	584	4,759,226,665	4,691,529,427	0.30
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	88	1,417,912,192	1,427,505,411	0.09
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	37	1,087,877,613	1,115,077,029	0.07
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep24	買建	35	684,052,407	690,051,337	0.04

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	MINI MSCI EMG MKT Sep24	買建	668	5,543,585,593	5,459,611,160	5.64

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０６０９月	買建	2,857	4,856,500,020	4,892,612,500	2.87

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
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	152	801,480,739	843,188,323	0.89

（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。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2024年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第5計算期間末（2015年1月13日）	1,260	1,260	1.8245	1.8245
第6計算期間末（2016年1月12日）	1,328	1,328	1.6123	1.6123
第7計算期間末（2017年1月11日）	1,504	1,504	1.8427	1.8427
第8計算期間末（2018年1月11日）	1,624	1,624	2.2013	2.2013

第9計算期間末 (2019年1月11日)	1,440	1,440	1.9238	1.9238
第10計算期間末 (2020年1月14日)	1,666	1,666	2.3403	2.3403
第11計算期間末 (2021年1月12日)	1,720	1,720	2.5239	2.5239
第12計算期間末 (2022年1月11日)	1,662	1,662	2.9538	2.9538
第13計算期間末 (2023年1月11日)	1,627	1,627	2.8570	2.8570
第14計算期間末 (2024年1月11日)	1,939	1,939	3.4538	3.4538
2023年7月末日	1,882	－	3.3129	－
8月末日	1,901	－	3.3316	－
9月末日	1,865	－	3.2546	－
10月末日	1,814	－	3.1598	－
11月末日	1,912	－	3.3607	－
12月末日	1,925	－	3.4148	－
2024年1月末日	1,959	－	3.5234	－
2月末日	2,044	－	3.6811	－
3月末日	2,108	－	3.8099	－
4月末日	2,149	－	3.8870	－
5月末日	2,186	－	3.9471	－
6月末日	2,311	－	4.1553	－
7月末日	2,205	－	3.9586	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
2024年1月12日～2024年7月11日	－

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第5計算期間	18.3
第6計算期間	△11.6
第7計算期間	14.3
第8計算期間	19.5
第9計算期間	△12.6
第10計算期間	21.6
第11計算期間	7.8

第12計算期間	17.0
第13計算期間	△3.3
第14計算期間	20.9
2024年1月12日～2024年7月11日	23.8

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

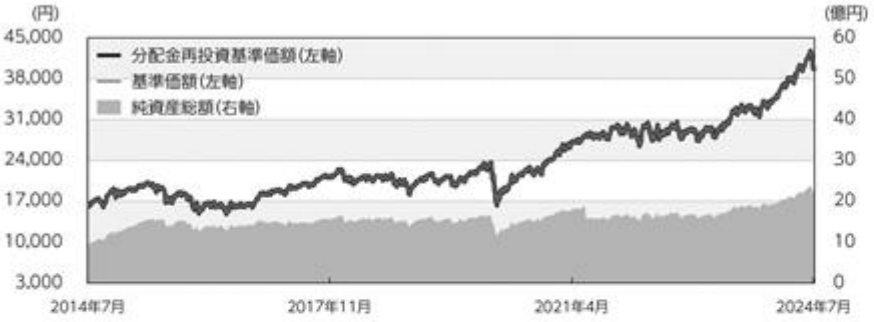
	設定口数	解約口数
第5計算期間	349,195,243	151,369,883
第6計算期間	321,028,252	187,743,422
第7計算期間	144,022,619	151,648,359
第8計算期間	120,096,408	198,602,077
第9計算期間	109,103,259	98,422,624
第10計算期間	71,524,464	107,806,247
第11計算期間	86,431,668	116,981,457
第12計算期間	66,317,522	185,261,047
第13計算期間	58,108,496	51,146,544
第14計算期間	46,696,679	54,922,220
2024年1月12日～ 2024年7月11日	21,975,170	26,672,815

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2024年7月31日

基準価額・純資産の推移 《2014年7月31日～2024年7月31日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2010年5月28日)

分配の推移(税引前)

2020年 1月	0円
2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
2024年 1月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	46.73
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	31.03
3	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.62
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6.86
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	2.88
6	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.96
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.47
8	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.35

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.85
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.58
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.33
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.96
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.85

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.03
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.68
3	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.06
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.67
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	1.59

○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7月31日

■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	8.96
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	3.81
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.57
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	1.93
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.41

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	145回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.33
2	163回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.4	2028/9/20	1.23
3	373回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2033/12/20	1.13
4	156回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.2	2027/12/20	1.10
5	374回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2034/3/20	1.00

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.51
2	US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	アメリカ	1.5	2027/1/31	0.49
3	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.44
4	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	0.44
5	US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	アメリカ	1.375	2031/11/15	0.43

■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	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	国債証券	サウジアラビア	5.5	2032/10/25	1.78
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	1.69
3	HUNGARY 5.25 06/16/29	国債証券	ハンガリー	5.25	2029/6/16	1.59
4	ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	ルーマニア	7.125	2033/1/17	1.58
5	HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	ハンガリー	6.25	2032/9/22	1.53

○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7月31日

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.59
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.21
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.66
4	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.60
5	GLP投資法人	投資証券	日本	4.31

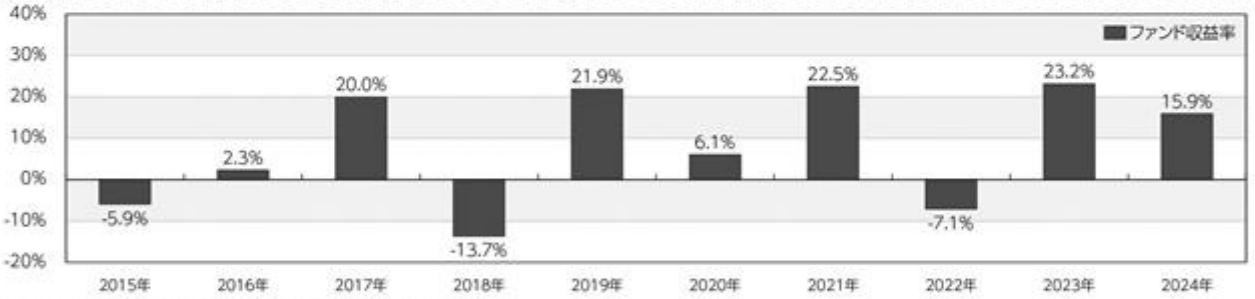
■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	8.09
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.05
3	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	4.65
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.52
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.49

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合に、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって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は、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）することができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）にお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

※受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、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係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、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係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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係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。

なお、収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※収益分配金の再投資については、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、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約を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、この信託契約の一部を解約します。解約のお申込みの受付は、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、解約の請求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、解約の請求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解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該解約に係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、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

※委託会社は、金融商品取引所等おける取引の停止、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、解約の請求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。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の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から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

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。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日に計算されます。
※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社への問い合わせ
・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2010年5月28日から2045年1月11日までです。
※下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。
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1月12日から翌年1月11日までとします。
b.上記a.の規定にかかわらず、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。

（５）【その他】
イ．償還規定
a.委託会社は、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合またはやむを得ない事情が発生した場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、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、書面決議の日ならびに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、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
c.上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ．償還規定c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
e.上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情

が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

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

g.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この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、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

h.受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記 「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、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、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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、この信託約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

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、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

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

h.委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a.からg.の規定にしたがい信託約款を変更します。

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。

当ファンドの投資顧問契約について、委託会社とイボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社（投資顧問会社）との間の当該契約は、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

（URL https://www.am-one.co.jp/）

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

ホ. 運用報告書

・委託会社は、毎年1月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

（URL　https://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため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。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

③一部解約請求権

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間（2023年1月12日から2024年1月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド　エボリューション】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 2023年1月11日現在	第14期 2024年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,389,841	39,445,283
親投資信託受益証券	1,606,289,641	1,917,649,475
未収入金	6,600,000	－
流動資産合計	1,647,279,482	1,957,094,758
資産合計	1,647,279,482	1,957,094,758
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,382,833	11,873,097
未払受託者報酬	368,334	417,826
未払委託者報酬	4,696,853	5,327,924
その他未払費用	32,690	37,089
流動負債合計	19,480,710	17,655,936
負債合計	19,480,710	17,655,936
純資産の部		
元本等		
元本	569,758,557	561,533,016
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,058,040,215	1,377,905,806
（分配準備積立金）	565,549,002	763,393,935
元本等合計	1,627,798,772	1,939,438,822
純資産合計	1,627,798,772	1,939,438,822
負債純資産合計	1,647,279,482	1,957,094,758

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日	第14期 自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
営業収益		
受取利息	220	322
有価証券売買等損益	△44,567,791	351,458,534
営業収益合計	△44,567,571	351,458,856
営業費用		
支払利息	10,947	13,070
受託者報酬	724,394	790,216
委託者報酬	9,237,198	10,076,353
その他費用	70,242	76,088
営業費用合計	10,042,781	10,955,727
営業利益又は営業損失（△）	△54,610,352	340,503,129
経常利益又は経常損失（△）	△54,610,352	340,503,129
当期純利益又は当期純損失（△）	△54,610,352	340,503,129
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（△）	△3,727,301	17,881,814
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,099,576,706	1,058,040,215
剰余金増加額又は欠損金減少額	109,041,314	99,758,467
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	109,041,314	99,758,467
剰余金減少額又は欠損金増加額	99,694,754	102,514,191
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	99,694,754	102,514,191
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,058,040,215	1,377,905,806

（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14期 自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第13期 2023年1月11日現在	第14期 2024年1月11日現在
１．　期首元本額	562,796,605円	569,758,557円
期中追加設定元本額	58,108,496円	46,696,679円
期中一部解約元本額	51,146,544円	54,922,220円
２．　受益権の総数	569,758,557口	561,533,016口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第13期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日	第14期 自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（29,325,986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（493,369,332円）及び分配準備積立金（536,223,016円）より分配対象収益は1,058,918,334円（1万口当たり18,585.38円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（42,698,952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（207,078,675円）、信託約款に規定される収益調整金（614,511,871円）及び分配準備積立金（513,616,308円）より分配対象収益は1,377,905,806円（1万口当たり24,538.28円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第13期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日	第14期 自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 2023年1月11日現在	第14期 2024年1月11日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第13期 2023年1月11日現在	第14期 2024年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	△46,656,955	338,722,929
合計	△46,656,955	338,722,929

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第13期 2023年1月11日現在	第14期 2024年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.8570円 (28,570円)	3.4538円 (34,538円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
（１）株式
該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	14,869,106	64,432,297	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,416,875	5,518,001	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	4,117,615	9,718,394	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	120,402,683	942,403,840	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,215,627	34,702,280	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	75,897,601	144,972,007	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	366,664,055	564,919,309	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	66,803,835	150,983,347	
親投資信託受益証券　合計		668,387,397	1,917,649,475	
合計			1,917,649,475	

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

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	28,097,109,910
株式	501,152,764,250
派生商品評価勘定	1,429,566,430
未収入金	61,619,540
未収配当金	687,467,511
差入委託証拠金	1,374,581,790
流動資産合計	532,803,109,431
資産合計	532,803,109,431
負債の部	
流動負債	
前受金	932,237,300
未払解約金	1,646,755,000
流動負債合計	2,578,992,300
負債合計	2,578,992,300
純資産の部	
元本等	
元本	122,361,611,329
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	407,862,505,802
元本等合計	530,224,117,131
純資産合計	530,224,117,131
負債純資産合計	532,803,109,431

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	113,153,180,874円
同期中追加設定元本額	63,554,547,819円
同期中一部解約元本額	54,346,117,364円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＨＡＭスリーウェイオープン	234,935,632円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸオープン	2,473,484,233円
たわらノーロード　国内株式＜ラップ専用＞	3,251,710,364円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	30,128,161,090円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	4,578,155,640円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,572,967円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,370,446円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	21,489,905円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	21,851,349円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	28,800,675円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	18,230,649円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	2,142,968,356円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,698,970,509円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	50,616,376円
たわらノーロード　バランス（標準型）	371,245,453円
たわらノーロード　バランス（積極型）	626,205,996円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	2,443,029円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	150,046,225円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	426,397,837円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	360,214,784円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	491,049,787円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	392,260円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,449,190円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	29,609,493円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,163,607円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,723,802円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,283,833,810円
Ｏｎｅグローバルバランス	38,892,141円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	937,705,041円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,369,839,529円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,882,880,690円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	302,608,796円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	977,799,372円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,099,113,897円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,077,856,603円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	14,869,106円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	291,662,409円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	335,914,476円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	572,339,121円
投資のソムリエ	9,225,448,791円
クルーズコントロール	360,259,264円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	887,270,886円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	331,013,661円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,096,253,235円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	998,753,074円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,327,239,537円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	72,861,156円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	36,827,874円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	8,539,322円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	174,490,658円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	510,337,113円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,087,458,516円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	245,681,956円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	82,849,615円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	40,123,918円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	24,412,885円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	501,693,064円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	5,849,945円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,725,706円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	34,141,936円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	462,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	380,918円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	2,512,957円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	260,838円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	347,544円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	854,586円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	183,424,088円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	268,115円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	115,794,474円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	390,113,412円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	288,392,944円
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）	15,058,662円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,908,469円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	32,239,836円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	616,887円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	3,912,053円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,475,117円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	69,881,100円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,726,404円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,128,260円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,576,905円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	83,214円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,407,965円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,298,214円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	301,801,170円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	420,310,830円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,283,661,090円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	11,479,024円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	15,644,932円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	158,219,192円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	30,740,567円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	56,133円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	175,102,930円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,974,818円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,798,723円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,113,442円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	141,755,804円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,506,740円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,518,073円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	28,430,300円
コア資産形成ファンド	15,497,741円
ＭＨＡＭトピックスファンド	790,301,108円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	44,692,487円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	3,260,862,552円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,894,014,980円
計	122,361,611,329円
２．　受益権の総数	122,361,611,329口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月11日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	88,346,622,926
合計	88,346,622,926

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月8日から2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

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

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2024年1月11日現在

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

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

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

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

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

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

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

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

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

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	101,800	1,150.00	117,070,000	
明治電機工業	5,600	1,429.00	8,002,400	
ツルハホールディングス	31,600	12,935.00	408,746,000	
デリカフーズホールディングス	3,600	595.00	2,142,000	
スターティアホールディングス	2,200	1,365.00	3,003,000	
サンマルクホールディングス	12,100	2,169.00	26,244,900	
フェリシモ	1,900	962.00	1,827,800	
トリドールホールディングス	42,100	4,390.00	184,819,000	
帝人	136,900	1,374.00	188,100,600	
東レ	954,700	747.80	713,924,660	
クラレ	207,600	1,481.50	307,559,400	
旭化成	963,900	1,097.00	1,057,398,300	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	18,100	336.00	6,081,600	
稲葉製作所	7,700	1,548.00	11,919,600	
宮地エンジニアリンググループ	7,400	3,425.00	25,345,000	
トーカロ	42,400	1,530.00	64,872,000	
アルファ	2,900	1,437.00	4,167,300	
ＳＵＭＣＯ	260,800	2,171.50	566,327,200	
川田テクノロジーズ	3,500	7,100.00	24,850,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	9,900	2,996.00	29,660,400	
ジェイテックコーポレーション	1,000	2,290.00	2,290,000	
信和	5,300	778.00	4,123,400	
ビーロット	5,300	1,003.00	5,315,900	
ファーストブラザーズ	1,500	1,035.00	1,552,500	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	8,400	1,070.00	8,988,000	
シーアールイー	7,800	1,458.00	11,372,400	
ケイアイスター不動産	6,700	3,375.00	22,612,500	
アグレ都市デザイン	1,400	1,589.00	2,224,600	
グッドコムアセット	13,000	722.00	9,386,000	
ジェイ・エス・ビー	7,000	2,530.00	17,710,000	
ロードスターキャピタル	9,100	1,952.00	17,763,200	
テンポイノベーション	2,300	1,018.00	2,341,400	
グローバル・リンク・マネジメント	1,500	2,337.00	3,505,500	
フェイスネットワーク	2,100	1,523.00	3,198,300	
霞ヶ関キャピタル	3,300	9,000.00	29,700,000	
住江織物	1,600	2,415.00	3,864,000	
日本フエルト	4,900	429.00	2,102,100	
イチカワ	900	1,673.00	1,505,700	
エコナックホールディングス	7,200	131.00	943,200	
日東製網	800	1,550.00	1,240,000	
芦森工業	1,600	2,129.00	3,406,400	
アツギ	5,600	504.00	2,822,400	
ウイルプラスホールディングス	1,400	1,005.00	1,407,000	
ＪＭホールディングス	11,400	2,167.00	24,703,800	
コメダホールディングス	36,900	2,803.00	103,430,700	
サツドラホールディングス	3,800	800.00	3,040,000	
アレンザホールディングス	11,300	1,069.00	12,079,700	
串カツ田中ホールディングス	4,000	1,619.00	6,476,000	
バロックジャパンリミテッド	11,700	826.00	9,664,200	

クスリのアオキホールディングス	40,300	3,246.00	130,813,800	
ダイニック	2,500	734.00	1,835,000	
共和レザー	4,700	809.00	3,802,300	
ピーバンドットコム	1,000	409.00	409,000	
力の源ホールディングス	6,700	1,503.00	10,070,100	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	80,200	2,943.00	236,028,600	
アセンテック	5,800	504.00	2,923,200	
セーレン	27,500	2,490.00	68,475,000	
ソトー	2,500	701.00	1,752,500	
東海染工	800	873.00	698,400	
小松マテーレ	20,700	869.00	17,988,300	
ワコールホールディングス	29,200	3,544.00	103,484,800	
ホギメディカル	18,800	3,585.00	67,398,000	
クラウディアホールディングス	1,800	463.00	833,400	
ＴＳＩホールディングス	46,300	760.00	35,188,000	
マツオカコーポレーション	2,400	1,485.00	3,564,000	
ワールド	20,000	1,703.00	34,060,000	
ＴＩＳ	156,000	3,337.00	520,572,000	
テクミラホールディングス	3,700	474.00	1,753,800	
グリー	38,200	602.00	22,996,400	
GMOペパボ	1,700	1,225.00	2,082,500	
コーエーテクモホールディングス	89,400	1,767.00	157,969,800	
三菱総合研究所	7,000	4,755.00	33,285,000	
ボルテージ	2,300	266.00	611,800	
電算	800	1,512.00	1,209,600	
ＡＧＳ	3,300	850.00	2,805,000	
ファインデックス	11,300	942.00	10,644,600	
ブレインパッド	10,700	1,142.00	12,219,400	
ＫＬａｂ	26,200	290.00	7,598,000	
ポールトゥウィンホールディングス	24,400	475.00	11,590,000	
ネクソン	318,700	2,816.00	897,459,200	
アイスタイル	42,400	419.00	17,765,600	
エムアップホールディングス	17,400	1,044.00	18,165,600	
エイチーム	8,400	588.00	4,939,200	
エニグモ	18,200	364.00	6,624,800	
テクノスジャパン	7,100	647.00	4,593,700	
ｅｎｉｓｈ	7,100	161.00	1,143,100	
コロプラ	55,300	603.00	33,345,900	
オルトプラス	6,900	148.00	1,021,200	
ブロードリーフ	67,700	580.00	39,266,000	
クロス・マーケティンググループ	4,800	566.00	2,716,800	
デジタルハーツホールディングス	8,800	1,003.00	8,826,400	
メディアドゥ	6,400	1,433.00	9,171,200	
じげん	41,600	535.00	22,256,000	
ブイキューブ	17,100	307.00	5,249,700	
エンカレッジ・テクノロジ	1,900	575.00	1,092,500	
サイバーリンクス	3,100	804.00	2,492,400	
ディー・エル・イー	5,700	200.00	1,140,000	
フィックスターズ	16,100	1,304.00	20,994,400	

ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,600	1,429.00	9,431,400	
オプティム	14,600	941.00	13,738,600	
セレス	5,700	1,310.00	7,467,000	
ＳＨＩＦＴ	9,500	35,210.00	334,495,000	
特種東海製紙	7,800	4,085.00	31,863,000	
ティーガイア	14,800	1,977.00	29,259,600	
セック	1,500	5,020.00	7,530,000	
テクマトリックス	26,100	1,727.00	45,074,700	
プロシップ	6,900	1,407.00	9,708,300	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	37,200	2,482.00	92,330,400	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	28,500	9,737.00	277,504,500	
ザッパラス	2,200	473.00	1,040,600	
システムリサーチ	4,900	3,040.00	14,896,000	
インターネットイニシアティブ	68,200	2,938.00	200,371,600	
さくらインターネット	16,000	2,569.00	41,104,000	
ＧＭＯグローバルサイン・ホールディングス	4,400	2,768.00	12,179,200	
ＳＲＡホールディングス	7,300	3,770.00	27,521,000	
システムインテグレータ	2,300	426.00	979,800	
朝日ネット	15,400	626.00	9,640,400	
ｅＢＡＳＥ	20,000	771.00	15,420,000	
アバントグループ	18,100	1,476.00	26,715,600	
アドソル日進	6,000	1,593.00	9,558,000	
ＯＤＫソリューションズ	1,600	611.00	977,600	
フリービット	7,500	1,415.00	10,612,500	
コムチュア	20,600	1,884.00	38,810,400	
アステリア	11,200	651.00	7,291,200	
アイル	6,600	3,320.00	21,912,000	
王子ホールディングス	593,600	573.00	340,132,800	
日本製紙	80,300	1,320.00	105,996,000	
三菱製紙	10,700	572.00	6,120,400	
北越コーポレーション	70,100	1,480.00	103,748,000	
中越パルプ工業	3,200	1,915.00	6,128,000	
巴川コーポレーション	2,200	1,043.00	2,294,600	
大王製紙	62,900	1,152.00	72,460,800	
阿波製紙	2,200	563.00	1,238,600	
マークラインズ	7,700	3,000.00	23,100,000	
メディカル・データ・ビジョン	17,000	669.00	11,373,000	
ｇｕｍｉ	21,100	423.00	8,925,300	
ショーケース	1,800	305.00	549,000	
モバイルファクトリー	1,700	653.00	1,110,100	
テラスカイ	6,100	1,740.00	10,614,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,200	1,694.00	13,890,800	
ＰＣＩホールディングス	3,100	1,013.00	3,140,300	
アイビーシー	1,200	470.00	564,000	
ネオジャパン	4,800	1,052.00	5,049,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,800	1,863.00	5,216,400	
ラクス	67,500	2,431.00	164,092,500	

ランドコンピュータ	4,700	918.00	4,314,600	
ダブルスタンダード	4,400	1,606.00	7,066,400	
オープンドア	8,300	818.00	6,789,400	
マイネット	2,500	296.00	740,000	
アカツキ	6,700	2,432.00	16,294,400	
ベネフィットジャパン	500	1,246.00	623,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,500	1,622.00	7,299,000	
カナミックネットワーク	15,400	422.00	6,498,800	
ノムラシステムコーポレーション	8,700	119.00	1,035,300	
レンゴー	129,800	962.60	124,945,480	
トーモク	8,200	2,294.00	18,810,800	
ザ・パック	10,600	3,325.00	35,245,000	
チェンジホールディングス	31,000	1,419.00	43,989,000	
シンクロ・フード	5,000	637.00	3,185,000	
オークネット	5,600	1,935.00	10,836,000	
キャピタル・アセット・プランニング	1,600	766.00	1,225,600	
セグエグループ	2,500	915.00	2,287,500	
エイトレッド	1,100	1,429.00	1,571,900	
マクロミル	28,000	810.00	22,680,000	
ビーグリー	1,700	1,203.00	2,045,100	
オロ	5,200	2,969.00	15,438,800	
ユーザーローカル	5,200	1,846.00	9,599,200	
テモナ	1,800	298.00	536,400	
ニーズウェル	4,400	759.00	3,339,600	
マネーフォワード	31,700	4,447.00	140,969,900	
サインポスト	3,100	380.00	1,178,000	
レゾナック・ホールディングス	137,700	2,945.50	405,595,350	
住友化学	1,057,200	360.10	380,697,720	
住友精化	6,600	5,210.00	34,386,000	
日産化学	67,000	5,897.00	395,099,000	
ラサ工業	5,500	2,126.00	11,693,000	
クレハ	31,200	2,916.00	90,979,200	
多木化学	5,600	3,215.00	18,004,000	
テイカ	12,400	1,427.00	17,694,800	
石原産業	23,700	1,476.00	34,981,200	
片倉コープアグリ	1,900	1,132.00	2,150,800	
日本曹達	16,800	5,730.00	96,264,000	
東ソー	190,300	1,919.00	365,185,700	
トクヤマ	46,100	2,504.00	115,434,400	
セントラル硝子	15,300	2,776.00	42,472,800	
東亞合成	71,400	1,357.00	96,889,800	
大阪ソーダ	10,000	9,280.00	92,800,000	
関東電化工業	27,600	866.00	23,901,600	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	10,200	963.00	9,822,600	
デンカ	51,800	2,596.00	134,472,800	
イビデン	74,800	8,074.00	603,935,200	
信越化学工業	1,292,100	5,606.00	7,243,512,600	
日本カーバイド工業	5,300	1,495.00	7,923,500	
プラスアルファ・コンサルティング	8,400	2,753.00	23,125,200	
電算システムホールディングス	6,300	2,883.00	18,162,900	

堺化学工業	10,900	1,936.00	21,102,400	
第一稀元素化学工業	15,600	1,013.00	15,802,800	
エア・ウォーター	134,400	1,972.00	265,036,800	
日本酸素ホールディングス	138,300	3,894.00	538,540,200	
日本化学工業	5,200	1,907.00	9,916,400	
東邦アセチレン	8,500	376.00	3,196,000	
日本パーカライジング	63,500	1,158.00	73,533,000	
高圧ガス工業	20,800	891.00	18,532,800	
チタン工業	1,000	1,151.00	1,151,000	
四国化成ホールディングス	18,300	1,896.00	34,696,800	
戸田工業	3,300	1,575.00	5,197,500	
ステラ　ケミファ	7,700	3,290.00	25,333,000	
保土谷化学工業	4,500	3,795.00	17,077,500	
日本触媒	20,700	5,585.00	115,609,500	
大日精化工業	10,000	2,675.00	26,750,000	
カネカ	36,100	3,700.00	133,570,000	
協和キリン	172,400	2,528.50	435,913,400	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	48,700	1,848.00	89,997,600	
三菱瓦斯化学	106,400	2,418.00	257,275,200	
三井化学	117,500	4,407.00	517,822,500	
ＪＳＲ	155,200	4,058.00	629,801,600	
東京応化工業	68,100	3,207.00	218,396,700	
大阪有機化学工業	11,900	2,630.00	31,297,000	
三菱ケミカルグループ	1,041,600	903.30	940,877,280	
ＫＨネオケム	21,800	2,296.00	50,052,800	
ダイセル	183,200	1,463.00	268,021,600	
住友ベークライト	19,900	7,459.00	148,434,100	
積水化学工業	286,300	2,138.00	612,109,400	
日本ゼオン	97,700	1,316.00	128,573,200	
アイカ工業	35,900	3,550.00	127,445,000	
ＵＢＥ	67,800	2,418.00	163,940,400	
積水樹脂	21,300	2,495.00	53,143,500	
タキロンシーアイ	36,300	661.00	23,994,300	
旭有機材	9,500	3,970.00	37,715,000	
ニチバン	7,700	1,778.00	13,690,600	
リケンテクノス	30,600	859.00	26,285,400	
大倉工業	6,500	2,572.00	16,718,000	
積水化成品工業	20,000	500.00	10,000,000	
群栄化学工業	3,400	3,225.00	10,965,000	
タイガースポリマー	3,600	874.00	3,146,400	
ミライアル	2,600	1,489.00	3,871,400	
ダイキアクシス	3,300	732.00	2,415,600	
ダイキョーニシカワ	31,500	728.00	22,932,000	
竹本容器	3,100	782.00	2,424,200	
森六ホールディングス	7,400	2,847.00	21,067,800	
恵和	10,300	1,286.00	13,245,800	
日本化薬	108,800	1,379.00	150,035,200	
カーリットホールディングス	15,400	923.00	14,214,200	
ソルクシーズ	6,400	402.00	2,572,800	
ＣＬホールディングス	3,500	886.00	3,101,000	

プレステージ・インターナショナル	68,400	600.00	41,040,000	
フェイス	2,200	483.00	1,062,600	
プロトコーポレーション	15,700	1,310.00	20,567,000	
ハイマックス	4,500	1,451.00	6,529,500	
アミューズ	8,900	1,536.00	13,670,400	
野村総合研究所	316,100	4,408.00	1,393,368,800	
ドリームインキュベータ	5,000	3,170.00	15,850,000	
クイック	10,200	2,589.00	26,407,800	
ＴＡＣ	3,900	199.00	776,100	
ＣＥホールディングス	4,000	640.00	2,560,000	
日本システム技術	4,700	3,075.00	14,452,500	
電通グループ	143,700	3,914.00	562,441,800	
インテージホールディングス	16,200	1,753.00	28,398,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,900	1,176.00	5,762,400	
東邦システムサイエンス	4,700	1,274.00	5,987,800	
ぴあ	5,000	3,435.00	17,175,000	
イオンファンタジー	5,300	2,629.00	13,933,700	
ソースネクスト	65,300	165.00	10,774,500	
シーティーエス	18,500	687.00	12,709,500	
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	2,500	706.00	1,765,000	
インフォコム	18,400	2,435.00	44,804,000	
メディカルシステムネットワーク	16,300	671.00	10,937,300	
日本精化	9,500	3,100.00	29,450,000	
扶桑化学工業	15,200	4,440.00	67,488,000	
トリケミカル研究所	17,300	3,820.00	66,086,000	
シンプレクス・ホールディングス	21,500	2,784.00	59,856,000	
ＨＥＲＯＺ	4,800	1,752.00	8,409,600	
ラクスル	34,400	1,131.00	38,906,400	
メルカリ	86,500	2,528.50	218,715,250	
ＩＰＳ	4,000	2,025.00	8,100,000	
ＦＩＧ	9,300	322.00	2,994,600	
システムサポート	5,500	1,865.00	10,257,500	
ＡＤＥＫＡ	49,600	2,912.00	144,435,200	
日油	43,000	7,019.00	301,817,000	
ミヨシ油脂	2,900	1,312.00	3,804,800	
新日本理化	10,900	197.00	2,147,300	
ハリマ化成グループ	7,700	855.00	6,583,500	
イーソル	10,400	605.00	6,292,000	
東海ソフト	1,100	1,177.00	1,294,700	
ウイングアーク１ｓｔ	14,700	2,884.00	42,394,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,800	1,296.00	4,924,800	
サーバーワークス	2,900	3,200.00	9,280,000	
東名	600	1,800.00	1,080,000	
ヴィッツ	700	887.00	620,900	
トビラシステムズ	2,200	908.00	1,997,600	
Ｓａｎｓａｎ	46,700	1,485.00	69,349,500	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1,900	735.00	1,396,500	
ギフティ	12,500	1,695.00	21,187,500	
花王	322,200	5,950.00	1,917,090,000	

第一工業製薬	5,700	1,931.00	11,006,700	
石原ケミカル	6,500	1,965.00	12,772,500	
日華化学	3,200	939.00	3,004,800	
ニイタカ	1,400	1,894.00	2,651,600	
三洋化成工業	8,700	4,450.00	38,715,000	
メドレー	19,100	4,400.00	84,040,000	
ベース	4,900	3,450.00	16,905,000	
ＪＭＤＣ	24,300	4,210.00	102,303,000	
武田薬品工業	1,262,600	4,341.00	5,480,946,600	
アステラス製薬	1,251,500	1,764.00	2,207,646,000	
住友ファーマ	105,900	489.00	51,785,100	
塩野義製薬	179,900	7,256.00	1,305,354,400	
わかもと製薬	8,400	220.00	1,848,000	
日本新薬	37,400	5,189.00	194,068,600	
中外製薬	446,600	5,835.00	2,605,911,000	
科研製薬	24,400	3,495.00	85,278,000	
エーザイ	173,600	7,671.00	1,331,685,600	
理研ビタミン	12,100	2,300.00	27,830,000	
ロート製薬	138,200	3,106.00	429,249,200	
小野薬品工業	302,700	2,663.00	806,090,100	
久光製薬	31,700	4,562.00	144,615,400	
有機合成薬品工業	6,400	287.00	1,836,800	
持田製薬	16,400	3,400.00	55,760,000	
参天製薬	259,900	1,457.50	378,804,250	
扶桑薬品工業	5,100	1,996.00	10,179,600	
日本ケミファ	800	1,615.00	1,292,000	
ツムラ	44,800	2,751.50	123,267,200	
テルモ	397,700	4,980.00	1,980,546,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	42,800	2,793.50	119,561,800	
キッセイ薬品工業	23,700	3,245.00	76,906,500	
生化学工業	24,200	787.00	19,045,400	
栄研化学	26,200	1,729.00	45,299,800	
鳥居薬品	7,700	3,660.00	28,182,000	
ＪＣＲファーマ	48,300	1,214.00	58,636,200	
東和薬品	21,900	2,530.00	55,407,000	
富士製薬工業	10,600	1,903.00	20,171,800	
ゼリア新薬工業	19,700	2,054.00	40,463,800	
そーせいグループ	46,000	1,590.00	73,140,000	
第一三共	1,242,900	4,499.00	5,591,807,100	
杏林製薬	30,900	1,827.00	56,454,300	
大幸薬品	29,300	298.00	8,731,400	
ダイト	11,000	1,944.00	21,384,000	
大塚ホールディングス	296,700	5,868.00	1,741,035,600	
大正製薬ホールディングス	31,700	8,620.00	273,254,000	
ペプチドリーム	69,200	1,455.50	100,720,600	
大日本塗料	15,900	1,066.00	16,949,400	
日本ペイントホールディングス	756,600	1,156.00	874,629,600	
関西ペイント	139,600	2,603.50	363,448,600	
神東塗料	6,900	130.00	897,000	
中国塗料	29,300	1,752.00	51,333,600	

日本特殊塗料	5,700	1,252.00	7,136,400	
藤倉化成	17,500	440.00	7,700,000	
太陽ホールディングス	24,800	3,165.00	78,492,000	
ＤＩＣ	55,600	2,720.50	151,259,800	
サカタインクス	31,700	1,374.00	43,555,800	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	30,900	2,700.00	83,430,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	12,300	1,481.00	18,216,300	
アルプス技研	13,800	2,751.00	37,963,800	
サニックス	23,500	317.00	7,449,500	
日本空調サービス	15,900	833.00	13,244,700	
オリエンタルランド	773,900	5,462.00	4,227,041,800	
フォーカスシステムズ	9,500	1,014.00	9,633,000	
ダスキン	32,500	3,416.00	111,020,000	
パーク２４	90,900	1,857.50	168,846,750	
明光ネットワークジャパン	17,800	742.00	13,207,600	
ファルコホールディングス	6,600	2,149.00	14,183,400	
クレスコ	11,700	1,984.00	23,212,800	
フジ・メディア・ホールディングス	137,000	1,705.00	233,585,000	
秀英予備校	1,900	311.00	590,900	
田谷	1,400	415.00	581,000	
ラウンドワン	137,500	606.00	83,325,000	
リゾートトラスト	63,500	2,522.00	160,147,000	
オービック	47,600	24,945.00	1,187,382,000	
ジャストシステム	20,500	3,250.00	66,625,000	
ＴＤＣソフト	13,400	2,166.00	29,024,400	
ＬＩＮＥヤフー	2,030,700	485.90	986,717,130	
ビー・エム・エル	18,000	2,976.00	53,568,000	
トレンドマイクロ	67,400	8,179.00	551,264,600	
ＩＤホールディングス	9,700	1,707.00	16,557,900	
リソー教育	74,800	237.00	17,727,600	
日本オラクル	27,300	11,425.00	311,902,500	
早稲田アカデミー	8,100	1,793.00	14,523,300	
アルファシステムズ	3,700	3,095.00	11,451,500	
フューチャー	30,400	1,830.00	55,632,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,700	1,762.00	13,567,400	
ＳＢテクノロジー	6,000	2,420.00	14,520,000	
トーセ	2,200	720.00	1,584,000	
ユー・エス・エス	164,000	2,927.50	480,110,000	
オービックビジネスコンサルタント	20,000	6,880.00	137,600,000	
アイティフォー	18,300	1,218.00	22,289,400	
東京個別指導学院	17,400	451.00	7,847,400	
東計電算	4,000	3,570.00	14,280,000	
サイバーエージェント	323,100	924.90	298,835,190	
楽天グループ	1,252,400	643.70	806,169,880	
エックスネット	1,000	1,159.00	1,159,000	
クリーク・アンド・リバー社	7,400	2,211.00	16,361,400	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	28,800	649.00	18,691,200	
テー・オー・ダブリュー	28,800	330.00	9,504,000	
大塚商会	70,800	6,148.00	435,278,400	

サイボウズ	19,600	2,152.00	42,179,200	
山田コンサルティンググループ	6,300	1,776.00	11,188,800	
セントラルスポーツ	5,500	2,494.00	13,717,000	
パラカ	5,000	1,953.00	9,765,000	
電通総研	17,300	5,930.00	102,589,000	
ＡＣＣＥＳＳ	14,700	793.00	11,657,100	
デジタルガレージ	22,800	3,695.00	84,246,000	
イーエムシステムズ	23,800	726.00	17,278,800	
ウェザーニューズ	4,500	5,380.00	24,210,000	
ＣＩＪ	23,700	686.00	16,258,200	
ビジネスエンジニアリング	2,300	4,210.00	9,683,000	
日本エンタープライズ	8,200	128.00	1,049,600	
WOWOW	10,800	1,132.00	12,225,600	
スカラ	13,200	751.00	9,913,200	
インテリジェント　ウェイブ	4,300	1,025.00	4,407,500	
フルキャストホールディングス	13,900	1,889.00	26,257,100	
エン・ジャパン	23,800	2,751.00	65,473,800	
あすか製薬ホールディングス	14,500	1,824.00	26,448,000	
サワイグループホールディングス	32,600	5,514.00	179,756,400	
富士フイルムホールディングス	264,700	8,926.00	2,362,712,200	
コニカミノルタ	320,800	428.20	137,366,560	
資生堂	297,900	4,199.00	1,250,882,100	
ライオン	186,700	1,339.00	249,991,300	
高砂香料工業	10,700	3,580.00	38,306,000	
マンダム	30,800	1,303.00	40,132,400	
ミルボン	19,300	3,709.00	71,583,700	
ファンケル	62,400	2,370.50	147,919,200	
コーセー	29,100	10,335.00	300,748,500	
コタ	13,100	1,598.00	20,933,800	
シーボン	1,100	1,503.00	1,653,300	
ポーラ・オルビスホールディングス	73,100	1,564.00	114,328,400	
ノエビアホールディングス	12,700	5,290.00	67,183,000	
アジュバンホールディングス	2,000	937.00	1,874,000	
新日本製薬	8,100	1,763.00	14,280,300	
Ｉ－ｎｅ	2,800	2,475.00	6,930,000	
アクシージア	7,300	907.00	6,621,100	
エステー	11,000	1,552.00	17,072,000	
アグロ　カネショウ	5,700	1,495.00	8,521,500	
コニシ	41,200	1,433.00	59,039,600	
長谷川香料	27,300	3,225.00	88,042,500	
小林製薬	41,500	6,799.00	282,158,500	
荒川化学工業	12,000	1,062.00	12,744,000	
メック	11,700	4,395.00	51,421,500	
日本高純度化学	3,300	2,511.00	8,286,300	
タカラバイオ	38,400	1,253.00	48,115,200	
ＪＣＵ	16,000	3,755.00	60,080,000	
新田ゼラチン	5,400	779.00	4,206,600	
ＯＡＴアグリオ	4,200	1,765.00	7,413,000	
デクセリアルズ	35,800	4,335.00	155,193,000	
アース製薬	13,000	4,625.00	60,125,000	

北興化学工業	14,300	1,088.00	15,558,400	
大成ラミック	4,200	2,967.00	12,461,400	
クミアイ化学工業	56,600	865.00	48,959,000	
日本農薬	26,200	665.00	17,423,000	
富士興産	2,300	1,940.00	4,462,000	
ニチレキ	18,600	2,442.00	45,421,200	
ユシロ化学工業	7,400	1,775.00	13,135,000	
ビーピー・カストロール	3,100	883.00	2,737,300	
富士石油	41,600	371.00	15,433,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,800	1,358.00	3,802,400	
出光興産	792,000	805.30	637,797,600	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,258,700	595.70	1,345,507,590	
コスモエネルギーホールディングス	42,200	6,148.00	259,445,600	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	5,000	3,400.00	17,000,000	
テスホールディングス	30,100	444.00	13,364,400	
インフロニア・ホールディングス	160,800	1,498.50	240,958,800	
横浜ゴム	72,100	3,402.00	245,284,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	82,000	2,472.00	202,704,000	
ブリヂストン	417,700	6,100.00	2,547,970,000	
住友ゴム工業	139,800	1,650.00	230,670,000	
藤倉コンポジット	9,700	1,446.00	14,026,200	
オカモト	6,700	5,040.00	33,768,000	
アキレス	8,900	1,623.00	14,444,700	
フコク	7,500	1,396.00	10,470,000	
ニッタ	14,400	3,830.00	55,152,000	
クリエートメディック	2,500	897.00	2,242,500	
住友理工	22,200	1,121.00	24,886,200	
三ツ星ベルト	17,300	4,710.00	81,483,000	
バンドー化学	21,200	1,729.00	36,654,800	
ＡＧＣ	127,200	5,422.00	689,678,400	
日本板硝子	68,000	601.00	40,868,000	
石塚硝子	1,400	3,500.00	4,900,000	
有沢製作所	24,900	1,085.00	27,016,500	
日本山村硝子	2,900	1,408.00	4,083,200	
日本電気硝子	58,200	3,174.00	184,726,800	
オハラ	6,700	1,186.00	7,946,200	
住友大阪セメント	23,800	3,768.00	89,678,400	
太平洋セメント	84,400	2,986.00	252,018,400	
リソルホールディングス	700	6,050.00	4,235,000	
日本ヒューム	12,500	909.00	11,362,500	
日本コンクリート工業	27,800	360.00	10,008,000	
三谷セキサン	5,900	5,380.00	31,742,000	
アジアパイルホールディングス	20,200	727.00	14,685,400	
東海カーボン	131,600	1,055.50	138,903,800	
日本カーボン	7,600	4,420.00	33,592,000	
東洋炭素	10,100	4,895.00	49,439,500	
ノリタケカンパニーリミテド	7,900	7,170.00	56,643,000	
ＴＯＴＯ	94,100	3,916.00	368,495,600	
日本碍子	166,000	1,778.50	295,231,000	
日本特殊陶業	119,500	3,664.00	437,848,000	

ダントーホールディングス	5,300	1,082.00	5,734,600	
ＭＡＲＵＷＡ	5,300	28,780.00	152,534,000	
品川リフラクトリーズ	17,500	1,876.00	32,830,000	
黒崎播磨	2,900	11,780.00	34,162,000	
ヨータイ	8,800	1,495.00	13,156,000	
東京窯業	8,600	450.00	3,870,000	
ニッカトー	3,600	582.00	2,095,200	
フジミインコーポレーテッド	38,300	2,988.00	114,440,400	
クニミネ工業	2,300	1,042.00	2,396,600	
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,311.00	2,228,700	
ニチアス	36,000	3,410.00	122,760,000	
日本製鉄	657,300	3,349.00	2,201,297,700	
神戸製鋼所	295,100	1,930.00	569,543,000	
中山製鋼所	33,600	852.00	28,627,200	
合同製鐵	8,200	4,845.00	39,729,000	
ＪＦＥホールディングス	408,200	2,304.00	940,492,800	
東京製鐵	41,300	1,807.00	74,629,100	
共英製鋼	16,800	2,093.00	35,162,400	
大和工業	27,700	7,779.00	215,478,300	
東京鐵鋼	6,400	4,430.00	28,352,000	
大阪製鐵	6,900	2,428.00	16,753,200	
淀川製鋼所	16,700	3,960.00	66,132,000	
中部鋼鈑	9,700	2,474.00	23,997,800	
丸一鋼管	44,600	3,770.00	168,142,000	
モリ工業	2,600	4,525.00	11,765,000	
大同特殊鋼	92,500	1,501.50	138,888,750	
日本高周波鋼業	3,200	586.00	1,875,200	
日本冶金工業	10,800	4,360.00	47,088,000	
山陽特殊製鋼	14,500	2,624.00	38,048,000	
愛知製鋼	8,400	3,235.00	27,174,000	
日本金属	2,200	886.00	1,949,200	
ミガロホールディングス	1,100	1,401.00	1,541,100	
大平洋金属	12,600	1,199.00	15,107,400	
新日本電工	73,200	280.00	20,496,000	
栗本鐵工所	6,900	3,325.00	22,942,500	
虹　技	1,000	1,179.00	1,179,000	
日本鋳鉄管	800	1,130.00	904,000	
日本製鋼所	39,700	2,488.00	98,773,600	
三菱製鋼	10,900	1,513.00	16,491,700	
日亜鋼業	8,700	325.00	2,827,500	
日本精線	2,100	5,000.00	10,500,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,800	605.00	4,719,000	
大紀アルミニウム工業所	18,600	1,218.00	22,654,800	
日本軽金属ホールディングス	42,900	1,764.00	75,675,600	
三井金属鉱業	42,700	4,539.00	193,815,300	
東邦亜鉛	9,400	1,166.00	10,960,400	
三菱マテリアル	104,900	2,605.00	273,264,500	
住友金属鉱山	170,100	4,244.00	721,904,400	
ＤＯＷＡホールディングス	36,200	5,213.00	188,710,600	
古河機械金属	19,400	1,933.00	37,500,200	

エス・サイエンス	50,300	23.00	1,156,900	
大阪チタニウムテクノロジーズ	25,400	2,741.00	69,621,400	
東邦チタニウム	30,300	1,864.00	56,479,200	
ＵＡＣＪ	20,600	3,830.00	78,898,000	
ＣＫサンエツ	2,700	3,955.00	10,678,500	
古河電気工業	48,800	2,386.50	116,461,200	
住友電気工業	549,100	1,906.50	1,046,859,150	
フジクラ	173,100	1,137.00	196,814,700	
ＳＷＣＣ	16,400	2,890.00	47,396,000	
タツタ電線	26,100	703.00	18,348,300	
カナレ電気	1,400	1,618.00	2,265,200	
平河ヒューテック	9,400	1,385.00	13,019,000	
いよぎんホールディングス	166,700	985.40	164,266,180	
しずおかフィナンシャルグループ	311,300	1,266.50	394,261,450	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	118,000	1,023.00	120,714,000	
楽天銀行	48,700	2,242.00	109,185,400	
京都フィナンシャルグループ	177,200	2,320.50	411,192,600	
リョービ	15,700	2,851.00	44,760,700	
アーレスティ	8,900	744.00	6,621,600	
ＡＲＥホールディングス	55,200	1,990.00	109,848,000	
東洋製罐グループホールディングス	87,600	2,402.50	210,459,000	
ホッカンホールディングス	7,200	1,712.00	12,326,400	
コロナ	8,200	961.00	7,880,200	
横河ブリッジホールディングス	22,900	2,740.00	62,746,000	
駒井ハルテック	1,500	2,084.00	3,126,000	
高田機工	600	3,500.00	2,100,000	
三和ホールディングス	147,500	2,210.00	325,975,000	
文化シヤッター	38,300	1,455.00	55,726,500	
三協立山	16,800	848.00	14,246,400	
アルインコ	11,200	1,034.00	11,580,800	
東洋シヤッター	1,900	678.00	1,288,200	
ＬＩＸＩＬ	229,100	1,890.50	433,113,550	
日本フイルコン	5,300	486.00	2,575,800	
ノーリツ	24,300	1,530.00	37,179,000	
長府製作所	14,500	2,094.00	30,363,000	
リンナイ	71,800	3,345.00	240,171,000	
ユニプレス	25,500	992.00	25,296,000	
ダイニチ工業	4,300	721.00	3,100,300	
日東精工	21,400	549.00	11,748,600	
三洋工業	900	2,904.00	2,613,600	
岡部	26,200	758.00	19,859,600	
ジーテクト	18,700	1,798.00	33,622,600	
東プレ	25,800	1,982.00	51,135,600	
高周波熱錬	22,600	1,000.00	22,600,000	
東京製綱	9,500	1,384.00	13,148,000	
サンコール	11,400	463.00	5,278,200	
モリテックスチール	7,300	294.00	2,146,200	
パイオラックス	18,200	2,463.00	44,826,600	
エイチワン	15,200	839.00	12,752,800	
日本発条	129,900	1,228.50	159,582,150	

中央発條	10,900	709.00	7,728,100	
アドバネクス	900	984.00	885,600	
三浦工業	60,000	2,844.50	170,670,000	
タクマ	48,600	1,777.00	86,362,200	
テクノプロ・ホールディングス	85,600	3,664.00	313,638,400	
アトラグループ	2,400	190.00	456,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,600	1,611.00	12,243,600	
ＫｅｅＰｅｒ技研	8,900	6,660.00	59,274,000	
ファーストロジック	1,900	540.00	1,026,000	
三機サービス	1,200	1,377.00	1,652,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	11,600	733.00	8,502,800	
デザインワン・ジャパン	2,100	130.00	273,000	
イー・ガーディアン	5,500	1,612.00	8,866,000	
リブセンス	3,800	256.00	972,800	
ジャパンマテリアル	44,700	2,529.00	113,046,300	
ベクトル	18,000	1,147.00	20,646,000	
ウチヤマホールディングス	3,500	394.00	1,379,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,100	1,230.00	14,883,000	
キャリアリンク	5,400	2,481.00	13,397,400	
ＩＢＪ	11,200	680.00	7,616,000	
アサンテ	7,300	1,673.00	12,212,900	
バリューＨＲ	12,800	1,510.00	19,328,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	11,800	2,481.00	29,275,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,800	1,029.00	5,968,200	
ＥＲＩホールディングス	2,100	1,871.00	3,929,100	
アビスト	1,200	3,135.00	3,762,000	
シグマクシス・ホールディングス	19,700	1,336.00	26,319,200	
ウィルグループ	12,100	1,225.00	14,822,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	10,000	142.00	1,420,000	
メドピア	12,900	730.00	9,417,000	
レアジョブ	1,600	887.00	1,419,200	
リクルートホールディングス	1,082,600	5,934.00	6,424,148,400	
エラン	19,300	1,031.00	19,898,300	
ツガミ	31,900	1,210.00	38,599,000	
オークマ	12,600	6,302.00	79,405,200	
芝浦機械	14,300	3,570.00	51,051,000	
アマダ	229,200	1,562.50	358,125,000	
アイダエンジニアリング	33,300	851.00	28,338,300	
ＦＵＪＩ	67,600	2,518.00	170,216,800	
牧野フライス製作所	15,900	5,930.00	94,287,000	
オーエスジー	63,300	2,034.50	128,783,850	
ダイジェット工業	800	856.00	684,800	
旭ダイヤモンド工業	34,500	884.00	30,498,000	
ＤＭＧ森精機	87,100	2,792.50	243,226,750	
ソディック	34,900	745.00	26,000,500	
ディスコ	69,200	36,410.00	2,519,572,000	
日東工器	7,000	1,924.00	13,468,000	
日進工具	13,300	1,101.00	14,643,300	

パンチ工業	7,800	418.00	3,260,400	
冨士ダイス	7,500	675.00	5,062,500	
土木管理総合試験所	3,700	346.00	1,280,200	
日本郵政	1,718,400	1,304.00	2,240,793,600	
ベルシステム２４ホールディングス	15,700	1,650.00	25,905,000	
鎌倉新書	12,500	575.00	7,187,500	
ＳＭＮ	1,500	313.00	469,500	
一蔵	1,000	592.00	592,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,500	653.00	979,500	
エアトリ	10,700	1,852.00	19,816,400	
アトラエ	8,600	701.00	6,028,600	
ストライク	6,200	4,510.00	27,962,000	
ソラスト	40,400	611.00	24,684,400	
セラク	4,500	1,263.00	5,683,500	
インソース	31,700	872.00	27,642,400	
豊田自動織機	121,300	12,200.00	1,479,860,000	
豊和工業	4,400	762.00	3,352,800	
石川製作所	2,000	1,130.00	2,260,000	
リケンＮＰＲ	15,700	2,574.00	40,411,800	
東洋機械金属	6,500	716.00	4,654,000	
津田駒工業	1,500	376.00	564,000	
エンシュウ	1,900	682.00	1,295,800	
島精機製作所	22,900	1,571.00	35,975,900	
オプトラン	23,700	1,615.00	38,275,500	
ＮＣホールディングス	1,900	1,930.00	3,667,000	
イワキ	9,700	2,132.00	20,680,400	
フリュー	13,500	1,338.00	18,063,000	
ヤマシンフィルタ	34,600	336.00	11,625,600	
日阪製作所	15,700	955.00	14,993,500	
やまびこ	23,500	1,519.00	35,696,500	
野村マイクロ・サイエンス	4,900	16,070.00	78,743,000	
平田機工	6,900	6,580.00	45,402,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	15,900	460.00	7,314,000	
マルマエ	6,200	2,158.00	13,379,600	
タツモ	8,600	2,991.00	25,722,600	
ナブテスコ	90,100	2,907.50	261,965,750	
三井海洋開発	18,200	2,133.00	38,820,600	
レオン自動機	16,600	1,568.00	26,028,800	
ＳＭＣ	43,000	82,150.00	3,532,450,000	
ホソカワミクロン	9,200	4,140.00	38,088,000	
ユニオンツール	6,300	3,455.00	21,766,500	
瑞光	10,400	1,888.00	19,635,200	
オイレス工業	19,400	2,105.00	40,837,000	
日精エー・エス・ビー機械	5,700	4,415.00	25,165,500	
サトーホールディングス	20,300	2,185.00	44,355,500	
技研製作所	13,500	2,231.00	30,118,500	
日本エアーテック	6,600	1,236.00	8,157,600	
カワタ	2,500	1,089.00	2,722,500	
日精樹脂工業	10,700	1,158.00	12,390,600	
オカダアイヨン	2,600	2,653.00	6,897,800	

ワイエイシイホールディングス	4,800	2,358.00	11,318,400	
小松製作所	673,400	3,884.00	2,615,485,600	
住友重機械工業	85,000	3,635.00	308,975,000	
日立建機	57,300	3,943.00	225,933,900	
日工	21,400	720.00	15,408,000	
巴工業	5,600	3,785.00	21,196,000	
井関農機	13,400	1,112.00	14,900,800	
ＴＯＷＡ	16,000	6,990.00	111,840,000	
丸山製作所	1,400	2,620.00	3,668,000	
北川鉄工所	5,700	1,363.00	7,769,100	
シンニッタン	10,400	266.00	2,766,400	
ローツェ	7,500	15,000.00	112,500,000	
タカキタ	2,600	502.00	1,305,200	
クボタ	753,900	2,197.50	1,656,695,250	
荏原実業	7,600	2,984.00	22,678,400	
東洋エンジニアリング	20,500	777.00	15,928,500	
三菱化工機	5,100	3,350.00	17,085,000	
月島ホールディングス	19,400	1,393.00	27,024,200	
帝国電機製作所	10,200	3,065.00	31,263,000	
東京機械製作所	2,100	494.00	1,037,400	
新東工業	29,100	1,111.00	32,330,100	
澁谷工業	13,500	2,502.00	33,777,000	
アイチコーポレーション	20,000	1,125.00	22,500,000	
小森コーポレーション	35,400	1,321.00	46,763,400	
鶴見製作所	11,000	3,880.00	42,680,000	
日本ギア工業	3,100	532.00	1,649,200	
酒井重工業	2,000	6,480.00	12,960,000	
荏原製作所	59,000	8,760.00	516,840,000	
石井鐵工所	900	2,716.00	2,444,400	
酉島製作所	12,400	2,324.00	28,817,600	
北越工業	14,400	2,614.00	37,641,600	
ダイキン工業	171,600	24,210.00	4,154,436,000	
オルガノ	17,200	5,950.00	102,340,000	
トーヨーカネツ	4,900	4,075.00	19,967,500	
栗田工業	80,300	5,626.00	451,767,800	
椿本チエイン	20,300	4,080.00	82,824,000	
大同工業	3,500	752.00	2,632,000	
日機装	33,100	1,033.00	34,192,300	
木村化工機	11,000	748.00	8,228,000	
レイズネクスト	20,100	1,562.00	31,396,200	
アネスト岩田	22,200	1,236.00	27,439,200	
ダイフク	242,400	2,950.00	715,080,000	
サムコ	3,800	4,205.00	15,979,000	
加藤製作所	4,000	1,364.00	5,456,000	
油研工業	1,200	2,245.00	2,694,000	
タダノ	82,700	1,205.00	99,653,500	
フジテック	33,600	3,697.00	124,219,200	
ＣＫＤ	39,800	2,629.00	104,634,200	
平和	42,500	2,161.00	91,842,500	
理想科学工業	11,500	2,848.00	32,752,000	

ＳＡＮＫＹＯ	33,000	8,755.00	288,915,000	
日本金銭機械	17,300	1,448.00	25,050,400	
マースグループホールディングス	7,300	2,693.00	19,658,900	
フクシマガリレイ	9,400	5,250.00	49,350,000	
オーイズミ	2,900	433.00	1,255,700	
ダイコク電機	7,100	3,790.00	26,909,000	
竹内製作所	26,100	4,610.00	120,321,000	
アマノ	40,800	3,492.00	142,473,600	
ＪＵＫＩ	22,300	468.00	10,436,400	
サンデン	12,000	199.00	2,388,000	
ジャノメ	14,500	690.00	10,005,000	
ブラザー工業	191,900	2,348.50	450,677,150	
マックス	20,200	3,285.00	66,357,000	
モリタホールディングス	24,900	1,590.00	39,591,000	
グローリー	34,500	2,948.50	101,723,250	
新晃工業	14,400	2,928.00	42,163,200	
大和冷機工業	22,000	1,626.00	35,772,000	
セガサミーホールディングス	128,300	2,163.00	277,512,900	
ＴＰＲ	18,300	1,833.00	33,543,900	
ツバキ・ナカシマ	28,900	753.00	21,761,700	
ホシザキ	84,800	5,443.00	461,566,400	
大豊工業	12,500	861.00	10,762,500	
日本精工	265,900	800.60	212,879,540	
ＮＴＮ	311,500	273.90	85,319,850	
ジェイテクト	127,800	1,294.00	165,373,200	
不二越	10,600	3,800.00	40,280,000	
ミネベアミツミ	250,000	2,965.00	741,250,000	
日本トムソン	39,100	581.00	22,717,100	
ＴＨＫ	82,900	2,888.50	239,456,650	
ユーシン精機	11,400	683.00	7,786,200	
前澤給装工業	11,000	1,368.00	15,048,000	
イーグル工業	15,900	1,695.00	26,950,500	
前澤工業	4,600	997.00	4,586,200	
日本ピラー工業	13,300	4,405.00	58,586,500	
キッツ	48,100	1,235.00	59,403,500	
日立製作所	690,500	11,045.00	7,626,572,500	
三菱電機	1,599,100	2,116.00	3,383,695,600	
富士電機	87,400	6,275.00	548,435,000	
東洋電機製造	2,500	1,019.00	2,547,500	
安川電機	156,000	6,037.00	941,772,000	
シンフォニア　テクノロジー	15,900	2,178.00	34,630,200	
明電舎	26,600	2,519.00	67,005,400	
オリジン	1,800	1,232.00	2,217,600	
山洋電気	6,200	6,330.00	39,246,000	
デンヨー	11,000	2,315.00	25,465,000	
ＰＨＣホールディングス	26,800	1,506.00	40,360,800	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	55,200	3,125.00	172,500,000	
ソシオネクスト	104,000	2,759.50	286,988,000	
ベイカレント・コンサルティング	107,400	4,715.00	506,391,000	

Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,200	1,035.00	3,312,000	
アイモバイル	19,300	441.00	8,511,300	
キャリアインデックス	2,700	222.00	599,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,700	1,174.00	5,517,800	
船場	1,700	873.00	1,484,100	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,400	2,297.00	108,877,800	
フルテック	1,100	1,192.00	1,311,200	
グリーンズ	2,900	1,888.00	5,475,200	
ツナググループ・ホールディングス	2,300	883.00	2,030,900	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	2,400	317.00	760,800	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,000	706.00	706,000	
ウェルビー	7,300	839.00	6,124,700	
エル・ティー・エス	1,700	2,900.00	4,930,000	
ミダックホールディングス	8,800	2,086.00	18,356,800	
キュービーネットホールディングス	7,000	1,509.00	10,563,000	
ＲＰＡホールディングス	19,800	272.00	5,385,600	
三櫻工業	21,800	844.00	18,399,200	
マキタ	163,800	3,968.00	649,958,400	
東芝テック	18,400	2,940.00	54,096,000	
芝浦メカトロニクス	8,100	6,200.00	50,220,000	
マブチモーター	71,400	2,436.50	173,966,100	
ニデック	317,200	5,844.00	1,853,716,800	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,100	368.00	3,348,800	
トレックス・セミコンダクター	7,400	1,763.00	13,046,200	
東光高岳	8,600	2,183.00	18,773,800	
ダブル・スコープ	41,100	867.00	35,633,700	
宮越ホールディングス	6,400	1,052.00	6,732,800	
ダイヘン	14,300	6,530.00	93,379,000	
ヤーマン	24,800	1,037.00	25,717,600	
ＪＶＣケンウッド	113,400	751.00	85,163,400	
ミマキエンジニアリング	13,600	875.00	11,900,000	
Ｉ－ＰＥＸ	10,000	1,651.00	16,510,000	
大崎電気工業	31,500	659.00	20,758,500	
オムロン	109,700	6,867.00	753,309,900	
日東工業	19,300	3,805.00	73,436,500	
ＩＤＥＣ	21,300	3,030.00	64,539,000	
正興電機製作所	2,600	1,094.00	2,844,400	
不二電機工業	1,600	1,190.00	1,904,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	56,100	2,080.00	116,688,000	
サクサホールディングス	1,800	2,617.00	4,710,600	
メルコホールディングス	4,600	3,475.00	15,985,000	
テクノメディカ	3,500	2,075.00	7,262,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,400	709.00	3,828,600	
日本電気	188,600	8,764.00	1,652,890,400	
富士通	132,200	20,740.00	2,741,828,000	
沖電気工業	64,900	968.00	62,823,200	
岩崎通信機	3,800	762.00	2,895,600	

電気興業	6,400	2,347.00	15,020,800	
サンケン電気	13,300	7,205.00	95,826,500	
ナカヨ	1,200	1,192.00	1,430,400	
アイホン	7,800	2,811.00	21,925,800	
ルネサスエレクトロニクス	937,600	2,397.00	2,247,427,200	
セイコーエプソン	184,400	2,217.50	408,907,000	
ワコム	109,200	691.00	75,457,200	
アルバック	34,200	6,725.00	229,995,000	
アクセル	5,000	2,268.00	11,340,000	
ＥＩＺＯ	10,600	5,020.00	53,212,000	
ジャパンディスプレイ	619,400	21.00	13,007,400	
日本信号	32,700	980.00	32,046,000	
京三製作所	30,100	470.00	14,147,000	
能美防災	19,400	2,207.00	42,815,800	
ホーチキ	10,800	1,828.00	19,742,400	
星和電機	3,500	486.00	1,701,000	
エレコム	34,400	1,713.00	58,927,200	
パナソニック　ホールディングス	1,697,200	1,459.50	2,477,063,400	
シャープ	242,200	1,070.50	259,275,100	
アンリツ	101,200	1,351.50	136,771,800	
富士通ゼネラル	40,700	2,311.00	94,057,700	
ソニーグループ	1,006,300	14,340.00	14,430,342,000	
ＴＤＫ	227,500	6,848.00	1,557,920,000	
帝国通信工業	6,200	1,981.00	12,282,200	
タムラ製作所	57,300	573.00	32,832,900	
アルプスアルパイン	128,200	1,291.00	165,506,200	
池上通信機	2,500	884.00	2,210,000	
日本電波工業	17,200	1,216.00	20,915,200	
鈴木	7,700	1,142.00	8,793,400	
メイコー	14,200	4,175.00	59,285,000	
日本トリム	3,300	3,025.00	9,982,500	
ローランド　ディー．ジー．	7,800	3,670.00	28,626,000	
フォスター電機	10,700	1,066.00	11,406,200	
ＳＭＫ	3,800	2,627.00	9,982,600	
ヨコオ	12,700	1,459.00	18,529,300	
ティアック	12,800	98.00	1,254,400	
ホシデン	32,600	1,760.00	57,376,000	
ヒロセ電機	21,300	17,695.00	376,903,500	
日本航空電子工業	34,400	3,155.00	108,532,000	
ＴＯＡ	16,400	1,110.00	18,204,000	
マクセル	31,700	1,619.00	51,322,300	
古野電気	18,700	1,883.00	35,212,100	
スミダコーポレーション	19,200	1,179.00	22,636,800	
アイコム	5,500	3,620.00	19,910,000	
リオン	5,900	2,271.00	13,398,900	
横河電機	157,200	2,890.00	454,308,000	
新電元工業	5,500	3,120.00	17,160,000	
アズビル	97,800	5,054.00	494,281,200	
東亜ディーケーケー	3,700	913.00	3,378,100	
日本光電工業	61,000	4,708.00	287,188,000	

チノー	5,900	2,382.00	14,053,800	
共和電業	7,400	398.00	2,945,200	
日本電子材料	8,700	1,739.00	15,129,300	
堀場製作所	27,200	11,290.00	307,088,000	
アドバンテスト	407,500	5,057.00	2,060,727,500	
小野測器	3,300	449.00	1,481,700	
エスペック	11,400	2,456.00	27,998,400	
キーエンス	142,300	65,620.00	9,337,726,000	
日置電機	6,700	6,380.00	42,746,000	
シスメックス	122,700	8,427.00	1,033,992,900	
日本マイクロニクス	25,500	3,920.00	99,960,000	
メガチップス	11,200	4,945.00	55,384,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,800	3,915.00	30,537,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	14,200	619.00	8,789,800	
澤藤電機	900	1,248.00	1,123,200	
デンソー	1,173,700	2,280.50	2,676,622,850	
原田工業	3,500	766.00	2,681,000	
コーセル	17,100	1,344.00	22,982,400	
イリソ電子工業	13,100	3,565.00	46,701,500	
オプテックスグループ	26,100	1,744.00	45,518,400	
千代田インテグレ	5,600	2,850.00	15,960,000	
レーザーテック	65,200	34,770.00	2,267,004,000	
スタンレー電気	91,000	2,772.00	252,252,000	
ウシオ電機	72,200	2,042.50	147,468,500	
岡谷電機産業	6,100	291.00	1,775,100	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	7,900	551.00	4,352,900	
エノモト	2,200	1,598.00	3,515,600	
日本セラミック	11,600	2,759.00	32,004,400	
遠藤照明	3,500	1,300.00	4,550,000	
古河電池	10,500	887.00	9,313,500	
双信電機	3,200	305.00	976,000	
山一電機	12,800	1,990.00	25,472,000	
図研	12,400	4,100.00	50,840,000	
日本電子	35,600	6,256.00	222,713,600	
カシオ計算機	102,800	1,252.00	128,705,600	
ファナック	693,700	4,307.00	2,987,765,900	
日本シイエムケイ	30,200	804.00	24,280,800	
エンプラス	4,200	13,330.00	55,986,000	
大真空	21,200	904.00	19,164,800	
ローム	263,000	2,662.00	700,106,000	
浜松ホトニクス	114,200	6,058.00	691,823,600	
三井ハイテック	12,600	7,085.00	89,271,000	
新光電気工業	50,200	5,483.00	275,246,600	
京セラ	884,000	2,162.50	1,911,650,000	
協栄産業	800	2,442.00	1,953,600	
太陽誘電	69,300	3,691.00	255,786,300	
村田製作所	1,294,200	2,987.50	3,866,422,500	
双葉電子工業	27,200	534.00	14,524,800	
日東電工	91,700	11,020.00	1,010,534,000	
北陸電気工業	2,900	1,394.00	4,042,600	

東海理化電機製作所	40,200	2,335.00	93,867,000	
ニチコン	37,300	1,305.00	48,676,500	
日本ケミコン	15,200	1,337.00	20,322,400	
ＫＯＡ	21,600	1,558.00	33,652,800	
三井Ｅ＆Ｓ	67,900	743.00	50,449,700	
日立造船	126,700	956.00	121,125,200	
三菱重工業	251,300	9,164.00	2,302,913,200	
川崎重工業	116,100	3,287.00	381,620,700	
ＩＨＩ	107,000	2,823.00	302,061,000	
名村造船所	30,900	1,206.00	37,265,400	
サノヤスホールディングス	11,700	139.00	1,626,300	
スプリックス	2,300	844.00	1,941,200	
マネジメントソリューションズ	6,200	3,070.00	19,034,000	
プロレド・パートナーズ	3,500	359.00	1,256,500	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	2,400	337.00	808,800	
テノ．ホールディングス	900	524.00	471,600	
フロンティア・マネジメント	3,700	1,418.00	5,246,600	
ピアラ	1,600	289.00	462,400	
コプロ・ホールディングス	2,600	1,591.00	4,136,600	
ギークス	1,000	500.00	500,000	
アンビスホールディングス	15,700	3,055.00	47,963,500	
カーブスホールディングス	40,000	726.00	29,040,000	
フォーラムエンジニアリング	19,900	840.00	16,716,000	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	5,000	1,098.00	5,490,000	
日本車輌製造	4,700	2,145.00	10,081,500	
三菱ロジスネクスト	22,700	1,438.00	32,642,600	
近畿車輌	1,000	1,920.00	1,920,000	
一家ホールディングス	2,100	678.00	1,423,800	
フルサト・マルカホールディングス	13,400	2,581.00	34,585,400	
ヤマエグループホールディングス	8,500	4,140.00	35,190,000	
ジャパンクラフトホールディングス	4,900	168.00	823,200	
ＦＰＧ	47,400	1,734.00	82,191,600	
島根銀行	2,200	525.00	1,155,000	
じもとホールディングス	6,900	548.00	3,781,200	
全国保証	36,600	5,444.00	199,250,400	
めぶきフィナンシャルグループ	695,200	438.80	305,053,760	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,000	4,115.00	74,070,000	
九州フィナンシャルグループ	271,100	838.00	227,181,800	
かんぽ生命保険	142,700	2,627.00	374,872,900	
ゆうちょ銀行	1,539,500	1,455.50	2,240,742,250	
あんしん保証	3,500	249.00	871,500	
富山第一銀行	44,400	772.00	34,276,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	751,600	672.50	505,451,000	
ジェイリース	3,700	2,136.00	7,903,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	79,000	1,639.00	129,481,000	
イントラスト	2,900	821.00	2,380,900	
日本モーゲージサービス	4,400	526.00	2,314,400	

ＣＡＳＡ	3,100	898.00	2,783,800	
ＳＢＩアルヒ	13,400	862.00	11,550,800	
プレミアグループ	23,600	1,816.00	42,857,600	
日産自動車	2,020,800	581.30	1,174,691,040	
いすゞ自動車	413,600	1,955.50	808,794,800	
トヨタ自動車	7,811,000	2,844.00	22,214,484,000	
日野自動車	213,900	496.80	106,265,520	
三菱自動車工業	554,900	468.00	259,693,200	
エフテック	5,500	665.00	3,657,500	
レシップホールディングス	3,500	680.00	2,380,000	
ＧＭＢ	1,600	1,237.00	1,979,200	
ファルテック	1,500	551.00	826,500	
武蔵精密工業	34,800	1,616.00	56,236,800	
日産車体	16,800	1,012.00	17,001,600	
新明和工業	41,000	1,193.00	48,913,000	
極東開発工業	23,500	1,993.00	46,835,500	
トピー工業	11,500	2,702.00	31,073,000	
ティラド	3,200	3,445.00	11,024,000	
曙ブレーキ工業	86,900	112.00	9,732,800	
タチエス	26,200	1,905.00	49,911,000	
ＮＯＫ	55,200	2,014.00	111,172,800	
フタバ産業	38,000	844.00	32,072,000	
カヤバ	13,700	5,160.00	70,692,000	
市光工業	25,500	587.00	14,968,500	
大同メタル工業	27,800	553.00	15,373,400	
プレス工業	56,700	605.00	34,303,500	
ミクニ	10,000	470.00	4,700,000	
太平洋工業	32,600	1,380.00	44,988,000	
河西工業	12,600	201.00	2,532,600	
アイシン	109,700	5,310.00	582,507,000	
マツダ	470,400	1,713.50	806,030,400	
今仙電機製作所	5,100	680.00	3,468,000	
本田技研工業	3,468,900	1,568.50	5,440,969,650	
スズキ	261,300	6,370.00	1,664,481,000	
ＳＵＢＡＲＵ	441,100	2,871.00	1,266,398,100	
安永	3,500	675.00	2,362,500	
ヤマハ発動機	614,700	1,329.50	817,243,650	
小糸製作所	147,400	2,264.00	333,713,600	
ＴＢＫ	8,600	395.00	3,397,000	
エクセディ	23,300	2,707.00	63,073,100	
ミツバ	26,600	1,059.00	28,169,400	
豊田合成	41,500	2,810.00	116,615,000	
愛三工業	23,600	1,252.00	29,547,200	
盟和産業	1,100	1,014.00	1,115,400	
日本プラスト	6,600	540.00	3,564,000	
ヨロズ	13,300	887.00	11,797,100	
エフ・シー・シー	25,100	1,850.00	46,435,000	
新家工業	1,800	2,941.00	5,293,800	
シマノ	57,800	22,670.00	1,310,326,000	
テイ・エス　テック	50,600	1,821.00	92,142,600	

三十三フィナンシャルグループ	12,600	1,881.00	23,700,600	
第四北越フィナンシャルグループ	22,000	3,955.00	87,010,000	
ひろぎんホールディングス	199,400	953.00	190,028,200	
マーキュリアホールディングス	4,000	708.00	2,832,000	
おきなわフィナンシャルグループ	11,900	2,374.00	28,250,600	
ダイレクトマーケティングミックス	15,200	455.00	6,916,000	
ポピンズ	2,200	1,180.00	2,596,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	11,400	1,969.00	22,446,600	
コンフィデンス・インターワークス	500	1,544.00	772,000	
十六フィナンシャルグループ	18,200	3,835.00	69,797,000	
北國フィナンシャルホールディングス	14,700	4,680.00	68,796,000	
ネットプロテクションズホールディングス	46,400	200.00	9,280,000	
プロクレアホールディングス	16,100	1,892.00	30,461,200	
ＦＰパートナー	2,700	5,250.00	14,175,000	
あいちフィナンシャルグループ	21,600	2,505.00	54,108,000	
ジャムコ	6,000	1,600.00	9,600,000	
小野建	14,800	1,807.00	26,743,600	
はるやまホールディングス	4,000	603.00	2,412,000	
南陽	1,700	2,182.00	3,709,400	
ノジマ	43,600	1,801.00	78,523,600	
佐鳥電機	7,400	2,135.00	15,799,000	
カッパ・クリエイト	23,700	1,750.00	41,475,000	
エコートレーディング	1,600	1,380.00	2,208,000	
伯東	8,600	5,900.00	50,740,000	
コンドーテック	11,500	1,191.00	13,696,500	
中山福	4,800	374.00	1,795,200	
ライトオン	6,300	446.00	2,809,800	
ナガイレーベン	19,000	2,504.00	47,576,000	
三菱食品	13,900	4,895.00	68,040,500	
良品計画	164,200	2,460.50	404,014,100	
パリミキホールディングス	10,500	511.00	5,365,500	
松田産業	11,400	2,472.00	28,180,800	
第一興商	58,200	2,121.00	123,442,200	
メディパルホールディングス	155,900	2,433.00	379,304,700	
アドヴァングループ	14,300	1,070.00	15,301,000	
ＳＰＫ	6,600	1,951.00	12,876,600	
萩原電気ホールディングス	6,400	4,795.00	30,688,000	
アルビス	5,000	2,675.00	13,375,000	
アズワン	23,600	5,528.00	130,460,800	
スズデン	5,300	2,481.00	13,149,300	
尾家産業	2,000	1,791.00	3,582,000	
シモジマ	10,400	1,336.00	13,894,400	
ドウシシャ	13,900	2,121.00	29,481,900	
小津産業	1,900	1,617.00	3,072,300	
コナカ	9,100	413.00	3,758,300	
高速	8,900	2,138.00	19,028,200	
ハウス　オブ　ローゼ	1,000	1,619.00	1,619,000	
Ｇ－７ホールディングス	16,400	1,240.00	20,336,000	
たけびし	5,800	1,965.00	11,397,000	

イオン北海道	44,400	935.00	41,514,000	
コジマ	24,900	781.00	19,446,900	
ヒマラヤ	2,600	943.00	2,451,800	
コーナン商事	18,500	4,010.00	74,185,000	
ネットワンシステムズ	57,600	2,379.50	137,059,200	
エコス	5,600	2,453.00	13,736,800	
ワタミ	16,000	1,038.00	16,608,000	
マルシェ	2,900	249.00	722,100	
リックス	2,600	3,545.00	9,217,000	
システムソフト	49,800	61.00	3,037,800	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	303,900	3,255.00	989,194,500	
丸文	13,400	1,631.00	21,855,400	
西松屋チェーン	29,600	2,078.00	61,508,800	
ゼンショーホールディングス	76,600	7,242.00	554,737,200	
ハピネット	12,800	2,833.00	36,262,400	
幸楽苑ホールディングス	11,200	1,271.00	14,235,200	
ハークスレイ	2,900	841.00	2,438,900	
橋本総業ホールディングス	5,900	1,332.00	7,858,800	
日本ライフライン	44,000	1,315.00	57,860,000	
サイゼリヤ	22,300	5,260.00	117,298,000	
タカショー	13,200	577.00	7,616,400	
ＶＴホールディングス	57,200	527.00	30,144,400	
アルゴグラフィックス	13,100	3,860.00	50,566,000	
魚力	5,300	2,325.00	12,322,500	
ＩＤＯＭ	39,900	960.00	38,304,000	
日本エム・ディ・エム	11,300	765.00	8,644,500	
ポプラ	2,200	194.00	426,800	
フジ・コーポレーション	7,400	1,707.00	12,631,800	
ユナイテッドアローズ	17,600	1,889.00	33,246,400	
進和	9,200	2,481.00	22,825,200	
エスケイジャパン	2,100	824.00	1,730,400	
ダイトロン	5,900	2,838.00	16,744,200	
ハイデイ日高	22,300	2,911.00	64,915,300	
シークス	21,500	1,490.00	32,035,000	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,600	154.00	708,400	
コロワイド	64,800	2,339.00	151,567,200	
田中商事	2,400	799.00	1,917,600	
オーハシテクニカ	8,000	1,897.00	15,176,000	
壱番屋	11,900	5,760.00	68,544,000	
白銅	4,400	2,394.00	10,533,600	
トップカルチャー	2,400	158.00	379,200	
ＰＬＡＮＴ	1,900	1,491.00	2,832,900	
スギホールディングス	30,300	6,662.00	201,858,600	
ダイコー通産	800	1,205.00	964,000	
薬王堂ホールディングス	7,400	2,625.00	19,425,000	
島津製作所	188,900	4,215.00	796,213,500	
ＪＭＳ	13,200	516.00	6,811,200	
クボテック	2,200	257.00	565,400	

長野計器	10,400	2,085.00	21,684,000	
ブイ・テクノロジー	7,500	2,806.00	21,045,000	
スター精密	26,700	1,768.00	47,205,600	
東京計器	10,900	1,761.00	19,194,900	
愛知時計電機	6,100	2,455.00	14,975,500	
インターアクション	6,700	1,064.00	7,128,800	
オーバル	7,000	503.00	3,521,000	
東京精密	29,100	9,066.00	263,820,600	
マニー	56,900	2,233.50	127,086,150	
ニコン	205,600	1,481.00	304,493,600	
トプコン	69,200	1,592.00	110,166,400	
オリンパス	875,600	2,167.50	1,897,863,000	
理研計器	10,100	6,640.00	67,064,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	48,600	12,150.00	590,490,000	
キヤノン電子	15,800	2,085.00	32,943,000	
タムロン	8,700	5,500.00	47,850,000	
ＨＯＹＡ	280,000	17,740.00	4,967,200,000	
シード	4,000	840.00	3,360,000	
ノーリツ鋼機	13,500	3,150.00	42,525,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	20,700	1,830.00	37,881,000	
朝日インテック	158,900	2,991.50	475,349,350	
キヤノン	709,500	3,746.00	2,657,787,000	
リコー	356,600	1,163.00	414,725,800	
シチズン時計	130,900	894.00	117,024,600	
リズム	1,800	2,962.00	5,331,600	
大研医器	6,700	511.00	3,423,700	
メニコン	48,900	2,394.50	117,091,050	
シンシア	900	535.00	481,500	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	11,700	192.00	2,246,400	
中本パックス	2,600	1,688.00	4,388,800	
スノーピーク	20,200	920.00	18,584,000	
パラマウントベッドホールディングス	29,600	2,803.00	82,968,800	
トランザクション	9,400	2,220.00	20,868,000	
粧美堂	2,100	673.00	1,413,300	
ニホンフラッシュ	13,300	927.00	12,329,100	
前田工繊	12,000	3,225.00	38,700,000	
永大産業	9,200	232.00	2,134,400	
アートネイチャー	12,900	809.00	10,436,100	
バンダイナムコホールディングス	389,700	2,996.50	1,167,736,050	
アイフィスジャパン	2,200	614.00	1,350,800	
ＳＨＯＥＩ	32,200	1,949.00	62,757,800	
フランスベッドホールディングス	18,400	1,412.00	25,980,800	
マーベラス	23,100	747.00	17,255,700	
パイロットコーポレーション	20,000	4,166.00	83,320,000	
萩原工業	9,500	1,507.00	14,316,500	
エイベックス	24,300	1,416.00	34,408,800	
フジシールインターナショナル	28,900	1,744.00	50,401,600	
タカラトミー	64,800	2,420.00	156,816,000	
広済堂ホールディングス	32,000	806.00	25,792,000	
エステールホールディングス	2,000	636.00	1,272,000	

レック	18,300	1,046.00	19,141,800	
タカノ	2,900	979.00	2,839,100	
三光合成	18,000	516.00	9,288,000	
プロネクサス	14,700	1,303.00	19,154,100	
ホクシン	6,100	115.00	701,500	
ウッドワン	2,800	1,042.00	2,917,600	
きもと	13,200	226.00	2,983,200	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	174,800	4,110.00	718,428,000	
大日本印刷	155,500	4,261.00	662,585,500	
共同印刷	4,000	3,340.00	13,360,000	
ＮＩＳＳＨＡ	24,400	1,569.00	38,283,600	
光村印刷	600	1,556.00	933,600	
藤森工業	11,300	3,910.00	44,183,000	
ヴィア・ホールディングス	12,500	184.00	2,300,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	9,100	2,695.00	24,524,500	
前澤化成工業	9,200	1,585.00	14,582,000	
未来工業	5,100	3,535.00	18,028,500	
アシックス	121,100	4,388.00	531,386,800	
ツツミ	2,400	2,325.00	5,580,000	
ウェーブロックホールディングス	2,900	654.00	1,896,600	
ＪＳＰ	10,100	1,924.00	19,432,400	
ニチハ	17,900	2,997.00	53,646,300	
ローランド	10,500	4,750.00	49,875,000	
エフピコ	27,100	2,988.00	80,974,800	
小松ウオール工業	5,800	2,987.00	17,324,600	
ヤマハ	89,700	3,422.00	306,953,400	
河合楽器製作所	4,400	3,560.00	15,664,000	
クリナップ	13,900	711.00	9,882,900	
ピジョン	90,600	1,652.50	149,716,500	
天馬	10,400	2,269.00	23,597,600	
キングジム	12,600	884.00	11,138,400	
象印マホービン	38,600	1,523.00	58,787,800	
リンテック	28,500	2,701.00	76,978,500	
信越ポリマー	30,700	1,653.00	50,747,100	
東リ	19,500	330.00	6,435,000	
イトーキ	29,200	1,360.00	39,712,000	
任天堂	898,100	7,930.00	7,121,933,000	
三菱鉛筆	20,100	2,063.00	41,466,300	
松風	6,400	2,792.00	17,868,800	
タカラスタンダード	29,900	1,708.00	51,069,200	
コクヨ	58,200	2,369.50	137,904,900	
ナカバヤシ	15,400	560.00	8,624,000	
ニフコ	42,700	3,902.00	166,615,400	
立川ブラインド工業	6,600	1,473.00	9,721,800	
グローブライド	12,800	2,022.00	25,881,600	
オカムラ	42,900	2,169.00	93,050,100	
バルカー	11,900	4,175.00	49,682,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	2,078.00	2,078,000	
伊藤忠商事	1,011,800	6,365.00	6,440,107,000	
丸紅	1,254,800	2,399.50	3,010,892,600	

スクロール	22,400	1,005.00	22,512,000	
高島	5,700	1,231.00	7,016,700	
ヨンドシーホールディングス	14,200	2,017.00	28,641,400	
三陽商会	4,700	2,495.00	11,726,500	
長瀬産業	68,900	2,350.50	161,949,450	
ナイガイ	2,600	268.00	696,800	
蝶理	9,400	2,931.00	27,551,400	
豊田通商	131,800	9,315.00	1,227,717,000	
オンワードホールディングス	84,000	508.00	42,672,000	
三共生興	20,900	737.00	15,403,300	
兼松	62,900	2,198.00	138,254,200	
美津濃	14,100	4,095.00	57,739,500	
ツカモトコーポレーション	1,100	1,267.00	1,393,700	
ルックホールディングス	3,500	2,388.00	8,358,000	
三井物産	1,134,000	5,693.00	6,455,862,000	
日本紙パルプ商事	7,200	5,020.00	36,144,000	
東京エレクトロン	301,000	26,080.00	7,850,080,000	
カメイ	16,000	1,836.00	29,376,000	
東都水産	400	7,200.00	2,880,000	
ＯＵＧホールディングス	1,200	2,449.00	2,938,800	
スターゼン	10,400	2,724.00	28,329,600	
セイコーグループ	19,800	2,707.00	53,598,600	
山善	45,700	1,193.00	54,520,100	
椿本興業	3,100	6,870.00	21,297,000	
住友商事	910,900	3,256.00	2,965,890,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	46,700	4,370.00	204,079,000	
内田洋行	6,100	7,090.00	43,249,000	
三菱商事	2,982,300	2,371.50	7,072,524,450	
第一実業	14,100	1,988.00	28,030,800	
キヤノンマーケティングジャパン	34,900	4,177.00	145,777,300	
西華産業	5,900	2,990.00	17,641,000	
佐藤商事	10,600	1,555.00	16,483,000	
菱洋エレクトロ	14,200	3,750.00	53,250,000	
東京産業	13,700	852.00	11,672,400	
ユアサ商事	11,700	4,825.00	56,452,500	
神鋼商事	3,800	5,920.00	22,496,000	
トルク	4,600	269.00	1,237,400	
阪和興業	27,100	5,210.00	141,191,000	
正栄食品工業	10,100	4,755.00	48,025,500	
カナデン	11,300	1,598.00	18,057,400	
ＲＹＯＤＥＮ	12,100	2,754.00	33,323,400	
ニプロ	118,500	1,166.50	138,230,250	
岩谷産業	34,300	6,660.00	228,438,000	
ナイス	2,600	1,698.00	4,414,800	
ニチモウ	2,400	2,114.00	5,073,600	
極東貿易	8,900	2,084.00	18,547,600	
アステナホールディングス	28,300	484.00	13,697,200	
三愛オブリ	36,100	1,680.00	60,648,000	
稲畑産業	29,800	3,070.00	91,486,000	
ＧＳＩクレオス	8,000	2,270.00	18,160,000	

明和産業	17,900	669.00	11,975,100	
クワザワホールディングス	3,100	683.00	2,117,300	
キムラタン	51,400	18.00	925,200	
ゴールドウイン	25,200	10,265.00	258,678,000	
ユニ・チャーム	297,300	5,247.00	1,559,933,100	
デサント	24,500	3,925.00	96,162,500	
キング	2,900	701.00	2,032,900	
ワキタ	24,900	1,600.00	39,840,000	
ヤマトインターナショナル	6,200	318.00	1,971,600	
東邦ホールディングス	41,600	3,266.00	135,865,600	
サンゲツ	34,700	3,210.00	111,387,000	
ミツウロコグループホールディングス	19,200	1,636.00	31,411,200	
シナネンホールディングス	4,200	4,275.00	17,955,000	
伊藤忠エネクス	37,300	1,651.00	61,582,300	
サンリオ	42,700	6,277.00	268,027,900	
サンワ　テクノス	7,700	2,269.00	17,471,300	
リョーサン	10,700	4,875.00	52,162,500	
新光商事	20,200	1,205.00	24,341,000	
トーホー	5,800	2,760.00	16,008,000	
三信電気	6,000	2,350.00	14,100,000	
東陽テクニカ	15,400	1,470.00	22,638,000	
モスフードサービス	22,200	3,380.00	75,036,000	
加賀電子	13,700	6,430.00	88,091,000	
三益半導体工業	11,300	3,235.00	36,555,500	
都築電気	7,500	2,273.00	17,047,500	
ソーダニッカ	11,100	1,170.00	12,987,000	
立花エレテック	10,100	2,916.00	29,451,600	
木曽路	22,800	2,637.00	60,123,600	
ＳＲＳホールディングス	24,800	1,146.00	28,420,800	
千趣会	27,700	338.00	9,362,600	
タカキュー	5,800	89.00	516,200	
リテールパートナーズ	22,300	1,685.00	37,575,500	
上新電機	14,800	2,465.00	36,482,000	
日本瓦斯	79,700	2,409.00	191,997,300	
ロイヤルホールディングス	26,500	2,583.00	68,449,500	
東天紅	600	842.00	505,200	
いなげや	14,100	1,322.00	18,640,200	
チヨダ	14,400	878.00	12,643,200	
ライフコーポレーション	15,800	3,485.00	55,063,000	
リンガーハット	19,400	2,416.00	46,870,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	19,000	645.00	12,255,000	
テンアライド	10,900	315.00	3,433,500	
ＡＯＫＩホールディングス	32,200	1,169.00	37,641,800	
オークワ	21,700	873.00	18,944,100	
コメリ	23,100	3,245.00	74,959,500	
青山商事	32,200	1,594.00	51,326,800	
しまむら	17,600	16,360.00	287,936,000	
はせがわ	4,000	371.00	1,484,000	
高島屋	104,000	2,017.00	209,768,000	
松屋	25,500	953.00	24,301,500	

エイチ・ツー・オー　リテイリング	66,500	1,597.00	106,200,500	
近鉄百貨店	6,400	2,652.00	16,972,800	
丸井グループ	100,000	2,470.00	247,000,000	
クレディセゾン	88,800	2,738.00	243,134,400	
アクシアル　リテイリング	10,300	4,100.00	42,230,000	
井筒屋	4,000	373.00	1,492,000	
イオン	510,200	3,328.00	1,697,945,600	
イズミ	26,700	3,607.00	96,306,900	
フォーバル	5,900	1,434.00	8,460,600	
平和堂	25,100	2,180.00	54,718,000	
フジ	23,100	1,902.00	43,936,200	
ヤオコー	17,000	8,385.00	142,545,000	
ゼビオホールディングス	20,300	969.00	19,670,700	
ケーズホールディングス	106,400	1,347.50	143,374,000	
ＰＡＬＴＡＣ	20,200	4,648.00	93,889,600	
三谷産業	26,400	385.00	10,164,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	3,600	553.00	1,990,800	
日産東京販売ホールディングス	12,500	463.00	5,787,500	
あおぞら銀行	100,700	3,146.00	316,802,200	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,530,900	1,281.00	10,928,082,900	
りそなホールディングス	1,633,700	751.70	1,228,052,290	
三井住友トラスト・ホールディングス	503,400	2,900.00	1,459,860,000	
三井住友フィナンシャルグループ	996,100	7,237.00	7,208,775,700	
千葉銀行	390,400	1,066.50	416,361,600	
群馬銀行	271,800	705.10	191,646,180	
武蔵野銀行	19,500	2,727.00	53,176,500	
千葉興業銀行	23,100	821.00	18,965,100	
筑波銀行	61,300	246.00	15,079,800	
七十七銀行	40,800	3,555.00	145,044,000	
秋田銀行	9,400	1,940.00	18,236,000	
山形銀行	15,600	1,097.00	17,113,200	
岩手銀行	8,800	2,582.00	22,721,600	
東邦銀行	110,900	296.00	32,826,400	
東北銀行	3,800	1,185.00	4,503,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	122,000	3,458.00	421,876,000	
スルガ銀行	123,500	845.00	104,357,500	
八十二銀行	300,600	783.50	235,520,100	
山梨中央銀行	15,700	1,734.00	27,223,800	
大垣共立銀行	26,700	1,884.00	50,302,800	
福井銀行	12,600	1,700.00	21,420,000	
清水銀行	5,600	1,555.00	8,708,000	
富山銀行	1,400	1,730.00	2,422,000	
滋賀銀行	23,400	3,500.00	81,900,000	
南都銀行	21,200	2,527.00	53,572,400	
百五銀行	131,700	554.00	72,961,800	
紀陽銀行	50,100	1,644.00	82,364,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	86,700	1,552.00	134,558,400	
山陰合同銀行	87,700	1,030.00	90,331,000	
鳥取銀行	2,700	1,400.00	3,780,000	
百十四銀行	13,700	2,428.00	33,263,600	

四国銀行	20,500	991.00	20,315,500	
阿波銀行	19,600	2,465.00	48,314,000	
大分銀行	8,400	2,615.00	21,966,000	
宮崎銀行	8,400	2,678.00	22,495,200	
佐賀銀行	8,200	1,909.00	15,653,800	
琉球銀行	29,800	1,129.00	33,644,200	
セブン銀行	439,100	307.70	135,111,070	
みずほフィナンシャルグループ	1,891,100	2,551.00	4,824,196,100	
高知銀行	2,600	918.00	2,386,800	
山口フィナンシャルグループ	137,300	1,338.00	183,707,400	
芙蓉総合リース	12,900	12,950.00	167,055,000	
みずほリース	23,500	5,150.00	121,025,000	
東京センチュリー	104,800	1,627.50	170,562,000	
ＳＢＩホールディングス	205,000	3,530.00	723,650,000	
日本証券金融	51,500	1,563.00	80,494,500	
アイフル	206,200	392.00	80,830,400	
日本アジア投資	5,700	262.00	1,493,400	
名古屋銀行	9,100	5,370.00	48,867,000	
北洋銀行	212,200	355.00	75,331,000	
大光銀行	2,500	1,300.00	3,250,000	
愛媛銀行	18,900	1,040.00	19,656,000	
トマト銀行	2,800	1,186.00	3,320,800	
京葉銀行	58,800	703.00	41,336,400	
栃木銀行	70,100	307.00	21,520,700	
北日本銀行	4,600	2,164.00	9,954,400	
東和銀行	25,600	620.00	15,872,000	
福島銀行	8,200	244.00	2,000,800	
大東銀行	3,400	768.00	2,611,200	
リコーリース	13,300	4,850.00	64,505,000	
イオンフィナンシャルサービス	80,300	1,337.50	107,401,250	
アコム	250,200	360.90	90,297,180	
ジャックス	14,800	5,450.00	80,660,000	
オリエントコーポレーション	45,700	1,094.00	49,995,800	
オリックス	853,900	2,801.00	2,391,773,900	
三菱ＨＣキャピタル	624,200	998.30	623,138,860	
ジャフコ　グループ	41,700	1,721.50	71,786,550	
九州リースサービス	3,100	1,082.00	3,354,200	
トモニホールディングス	113,300	382.00	43,280,600	
大和証券グループ本社	1,085,300	1,033.50	1,121,657,550	
野村ホールディングス	2,356,200	693.80	1,634,731,560	
岡三証券グループ	123,100	751.00	92,448,100	
丸三証券	46,600	892.00	41,567,200	
東洋証券	37,200	302.00	11,234,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	166,300	559.00	92,961,700	
光世証券	1,800	529.00	952,200	
水戸証券	41,400	459.00	19,002,600	
いちよし証券	26,300	761.00	20,014,300	
松井証券	68,900	782.00	53,879,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	210,700	7,303.00	1,538,742,100	

日本取引所グループ	365,500	3,161.00	1,155,345,500	
マネックスグループ	137,200	755.00	103,586,000	
極東証券	19,200	1,046.00	20,083,200	
岩井コスモホールディングス	16,000	1,921.00	30,736,000	
アイザワ証券グループ	20,200	1,334.00	26,946,800	
フィデアホールディングス	14,400	1,564.00	22,521,600	
池田泉州ホールディングス	194,000	327.00	63,438,000	
アニコム　ホールディングス	47,500	555.00	26,362,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	313,700	5,803.00	1,820,401,100	
マネーパートナーズグループ	8,100	293.00	2,373,300	
スパークス・グループ	15,700	1,690.00	26,533,000	
小林洋行	2,900	247.00	716,300	
第一生命ホールディングス	684,600	3,114.00	2,131,844,400	
東京海上ホールディングス	1,384,900	3,690.00	5,110,281,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	4,200	481.00	2,020,200	
イー・ギャランティ	22,800	2,005.00	45,714,000	
アサックス	3,500	733.00	2,565,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	6,900	3,525.00	24,322,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	376,100	2,361.00	887,972,100	
アドバンスクリエイト	8,100	1,024.00	8,294,400	
三井不動産	647,900	3,750.00	2,429,625,000	
三菱地所	915,900	2,089.50	1,913,773,050	
平和不動産	22,700	3,925.00	89,097,500	
東京建物	122,400	2,265.50	277,297,200	
京阪神ビルディング	26,200	1,400.00	36,680,000	
住友不動産	202,600	4,495.00	910,687,000	
太平洋興発	3,100	825.00	2,557,500	
テーオーシー	25,000	737.00	18,425,000	
東京楽天地	2,200	6,720.00	14,784,000	
レオパレス２１	140,100	421.00	58,982,100	
スターツコーポレーション	20,000	3,035.00	60,700,000	
フジ住宅	17,600	728.00	12,812,800	
空港施設	19,700	600.00	11,820,000	
明和地所	7,000	1,329.00	9,303,000	
ゴールドクレスト	11,400	2,312.00	26,356,800	
リログループ	73,300	1,676.50	122,887,450	
エスリード	6,500	3,645.00	23,692,500	
日神グループホールディングス	22,600	520.00	11,752,000	
日本エスコン	26,200	961.00	25,178,200	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	64,400	491.00	31,620,400	
ＡＶＡＮＴＩＡ	4,400	901.00	3,964,400	
イオンモール	72,600	1,817.00	131,914,200	
毎日コムネット	2,900	766.00	2,221,400	
ファースト住建	3,200	1,095.00	3,504,000	
ランド	766,600	8.00	6,132,800	
カチタス	37,700	2,085.00	78,604,500	
東祥	10,300	884.00	9,105,200	
トーセイ	23,400	2,126.00	49,748,400	
穴吹興産	1,600	2,041.00	3,265,600	

サンフロンティア不動産	20,700	1,774.00	36,721,800	
ＦＪネクストホールディングス	14,700	1,180.00	17,346,000	
インテリックス	2,000	508.00	1,016,000	
ランドビジネス	2,900	270.00	783,000	
サンネクスタグループ	2,300	969.00	2,228,700	
グランディハウス	9,200	639.00	5,878,800	
東武鉄道	156,200	4,037.00	630,579,400	
相鉄ホールディングス	50,900	2,808.50	142,952,650	
東急	398,800	1,799.50	717,640,600	
京浜急行電鉄	175,900	1,346.50	236,849,350	
小田急電鉄	235,200	2,323.00	546,369,600	
京王電鉄	68,300	4,644.00	317,185,200	
京成電鉄	91,700	7,058.00	647,218,600	
富士急行	17,500	4,690.00	82,075,000	
東日本旅客鉄道	261,400	8,441.00	2,206,477,400	
西日本旅客鉄道	168,700	6,109.00	1,030,588,300	
東海旅客鉄道	547,900	3,734.00	2,045,858,600	
西武ホールディングス	172,100	2,066.00	355,558,600	
鴻池運輸	24,200	1,952.00	47,238,400	
西日本鉄道	38,000	2,477.50	94,145,000	
ハマキョウレックス	12,100	4,220.00	51,062,000	
サカイ引越センター	15,800	2,771.00	43,781,800	
近鉄グループホールディングス	142,000	4,658.00	661,436,000	
阪急阪神ホールディングス	189,400	4,699.00	889,990,600	
南海電気鉄道	63,300	2,972.50	188,159,250	
京阪ホールディングス	78,300	3,787.00	296,522,100	
神戸電鉄	3,900	2,965.00	11,563,500	
名古屋鉄道	146,500	2,360.00	345,740,000	
山陽電気鉄道	10,700	2,193.00	23,465,100	
アルプス物流	11,300	1,772.00	20,023,600	
トランコム	4,200	7,190.00	30,198,000	
ヤマトホールディングス	181,900	2,646.00	481,307,400	
山九	36,100	5,310.00	191,691,000	
日新	10,800	2,567.00	27,723,600	
丸運	4,500	282.00	1,269,000	
丸全昭和運輸	8,700	4,045.00	35,191,500	
センコーグループホールディングス	75,200	1,157.00	87,006,400	
トナミホールディングス	3,200	4,690.00	15,008,000	
ニッコンホールディングス	45,500	3,147.00	143,188,500	
日本石油輸送	700	2,989.00	2,092,300	
福山通運	16,200	4,245.00	68,769,000	
セイノーホールディングス	79,800	2,175.00	173,565,000	
エスライングループ本社	2,200	906.00	1,993,200	
神奈川中央交通	4,000	3,075.00	12,300,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	34,400	1,548.00	53,251,200	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	13,700	1,592.00	21,810,400	
日本郵船	407,100	4,641.00	1,889,351,100	
商船三井	308,200	4,790.00	1,476,278,000	
川崎汽船	120,000	6,420.00	770,400,000	
ＮＳユナイテッド海運	7,600	4,920.00	37,392,000	

明海グループ	8,600	796.00	6,845,600	
飯野海運	52,200	1,260.00	65,772,000	
共栄タンカー	1,400	865.00	1,211,000	
九州旅客鉄道	100,400	3,262.00	327,504,800	
ＳＧホールディングス	238,500	2,101.50	501,207,750	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	48,200	8,443.00	406,952,600	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	8,700	3,475.00	30,232,500	
日本航空	348,800	2,838.00	989,894,400	
ＡＮＡホールディングス	386,400	3,200.00	1,236,480,000	
ビーウィズ	3,700	2,111.00	7,810,700	
パスコ	1,500	1,877.00	2,815,500	
ＴＲＥホールディングス	28,000	1,224.00	34,272,000	
人・夢・技術グループ	5,500	1,808.00	9,944,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,800	6,100.00	23,180,000	
シルバーライフ	2,800	866.00	2,424,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,201.00	1,320,600	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,500	5,580.00	36,270,000	
コーア商事ホールディングス	8,400	748.00	6,283,200	
ＫＰＰグループホールディングス	38,900	692.00	26,918,800	
ナルミヤ・インターナショナル	1,400	1,245.00	1,743,000	
ブックオフグループホールディングス	7,600	1,184.00	8,998,400	
ギフトホールディングス	6,300	2,504.00	15,775,200	
三菱倉庫	34,900	4,516.00	157,608,400	
三井倉庫ホールディングス	13,300	4,925.00	65,502,500	
住友倉庫	38,200	2,593.00	99,052,600	
澁澤倉庫	6,400	3,095.00	19,808,000	
ヤマタネ	6,600	2,613.00	17,245,800	
東陽倉庫	2,100	1,568.00	3,292,800	
乾汽船	16,600	1,128.00	18,724,800	
日本トランスシティ	28,600	648.00	18,532,800	
ケイヒン	1,400	1,793.00	2,510,200	
中央倉庫	7,600	1,174.00	8,922,400	
川西倉庫	1,500	1,210.00	1,815,000	
安田倉庫	9,800	1,244.00	12,191,200	
ファイズホールディングス	1,100	1,191.00	1,310,100	
ＮＩＳＳＯホールディングス	12,700	839.00	10,655,300	
大栄環境	26,600	2,566.00	68,255,600	
日本管財ホールディングス	15,400	2,618.00	40,317,200	
東洋埠頭	2,200	1,399.00	3,077,800	
上組	65,600	3,474.00	227,894,400	
サンリツ	1,900	777.00	1,476,300	
キムラユニティー	3,800	1,425.00	5,415,000	
キユーソー流通システム	5,700	911.00	5,192,700	
東海運	4,800	294.00	1,411,200	
エーアイテイー	8,800	1,800.00	15,840,000	
内外トランスライン	5,700	2,439.00	13,902,300	
ショーエイコーポレーション	2,600	605.00	1,573,000	
日本コンセプト	5,200	1,688.00	8,777,600	

ＴＢＳホールディングス	71,700	3,193.00	228,938,100	
日本テレビホールディングス	126,300	1,650.00	208,395,000	
朝日放送グループホールディングス	13,300	675.00	8,977,500	
テレビ朝日ホールディングス	34,700	1,693.00	58,747,100	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	110,800	717.00	79,443,600	
テレビ東京ホールディングス	10,300	3,125.00	32,187,500	
日本ＢＳ放送	2,800	908.00	2,542,400	
ビジョン	21,600	1,216.00	26,265,600	
スマートバリュー	1,900	392.00	744,800	
ＵＳＥＮ−ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	16,000	3,930.00	62,880,000	
ワイヤレスゲート	3,600	238.00	856,800	
日本通信	140,300	229.00	32,128,700	
クロップス	1,000	1,216.00	1,216,000	
日本電信電話	42,436,700	180.60	7,664,068,020	
ＫＤＤＩ	1,102,500	4,851.00	5,348,227,500	
ソフトバンク	2,295,200	1,883.00	4,321,861,600	
光通信	14,300	25,380.00	362,934,000	
エムティーアイ	9,900	654.00	6,474,600	
ＧＭＯインターネットグループ	52,700	2,582.00	136,071,400	
ファイバーゲート	7,700	911.00	7,014,700	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,200	243.00	534,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	75,500	3,022.00	228,161,000	
学研ホールディングス	23,700	1,017.00	24,102,900	
ゼンリン	24,300	893.00	21,699,900	
昭文社ホールディングス	3,500	362.00	1,267,000	
インプレスホールディングス	8,000	182.00	1,456,000	
東京電力ホールディングス	1,282,300	797.00	1,021,993,100	
中部電力	524,200	1,937.50	1,015,637,500	
関西電力	549,300	1,999.50	1,098,325,350	
中国電力	247,200	1,052.50	260,178,000	
北陸電力	145,400	741.90	107,872,260	
東北電力	374,400	985.20	368,858,880	
四国電力	132,500	1,070.50	141,841,250	
九州電力	327,900	1,061.50	348,065,850	
北海道電力	137,400	659.60	90,629,040	
沖縄電力	36,300	1,180.00	42,834,000	
電源開発	116,800	2,414.00	281,955,200	
エフオン	9,200	452.00	4,158,400	
イーレックス	25,300	816.00	20,644,800	
レノバ	37,900	1,216.00	46,086,400	
東京瓦斯	300,700	3,456.00	1,039,219,200	
大阪瓦斯	288,200	3,173.00	914,458,600	
東邦瓦斯	61,600	3,134.00	193,054,400	
北海道瓦斯	8,400	2,305.00	19,362,000	
広島ガス	30,100	400.00	12,040,000	
西部ガスホールディングス	14,700	2,011.00	29,561,700	
静岡ガス	28,400	1,058.00	30,047,200	
メタウォーター	17,000	2,117.00	35,989,000	

M&A総研ホールディングス	7,000	4,530.00	31,710,000	
アイネット	8,600	1,844.00	15,858,400	
松竹	7,400	9,861.00	72,971,400	
東宝	79,300	4,950.00	392,535,000	
エイチ・アイ・エス	42,500	1,825.00	77,562,500	
東映	4,800	21,230.00	101,904,000	
ラックランド	6,600	2,510.00	16,566,000	
ＮＴＴデータグループ	373,000	2,091.50	780,129,500	
共立メンテナンス	22,900	5,985.00	137,056,500	
イチネンホールディングス	15,500	1,601.00	24,815,500	
建設技術研究所	7,500	5,440.00	40,800,000	
スペース	9,500	941.00	8,939,500	
アインホールディングス	20,700	4,618.00	95,592,600	
燦ホールディングス	13,700	1,146.00	15,700,200	
ピー・シー・エー	8,200	1,165.00	9,553,000	
スバル興業	600	15,290.00	9,174,000	
東京テアトル	3,100	1,126.00	3,490,600	
タナベコンサルティンググループ	4,500	1,052.00	4,734,000	
ビジネスブレイン太田昭和	5,600	2,199.00	12,314,400	
ナガワ	4,600	7,810.00	35,926,000	
東京都競馬	12,200	4,545.00	55,449,000	
常磐興産	3,100	1,253.00	3,884,300	
カナモト	22,600	2,818.00	63,686,800	
ＤＴＳ	30,400	3,720.00	113,088,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	65,200	5,555.00	362,186,000	
シーイーシー	18,100	1,629.00	29,484,900	
カプコン	127,600	5,347.00	682,277,200	
ニシオホールディングス	13,600	4,015.00	54,604,000	
アイ・エス・ビー	7,300	1,480.00	10,804,000	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	52,700	23.00	1,212,100	
日本空港ビルデング	49,500	6,368.00	315,216,000	
トランス・コスモス	18,200	3,175.00	57,785,000	
乃村工藝社	63,800	881.00	56,207,800	
ジャステック	8,700	1,476.00	12,841,200	
ＳＣＳＫ	99,900	2,908.50	290,559,150	
藤田観光	5,800	6,000.00	34,800,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,700	1,333.00	11,597,100	
トーカイ	13,000	2,139.00	27,807,000	
白洋舎	1,200	2,394.00	2,872,800	
セコム	149,000	10,855.00	1,617,395,000	
ＮＳＷ	6,300	3,025.00	19,057,500	
セントラル警備保障	7,900	2,578.00	20,366,200	
アイネス	11,100	1,620.00	17,982,000	
丹青社	28,300	874.00	24,734,200	
メイテックグループホールディングス	52,600	2,956.50	155,511,900	
ＴＫＣ	22,600	3,795.00	85,767,000	
富士ソフト	28,800	6,240.00	179,712,000	
応用地質	13,600	2,126.00	28,913,600	

船井総研ホールディングス	30,400	2,658.00	80,803,200	
ＮＳＤ	50,900	2,816.00	143,334,400	
進学会ホールディングス	2,200	253.00	556,600	
丸紅建材リース	600	2,787.00	1,672,200	
オオバ	5,100	984.00	5,018,400	
コナミグループ	53,500	8,410.00	449,935,000	
いであ	2,200	1,774.00	3,902,800	
学究社	5,800	2,064.00	11,971,200	
ベネッセホールディングス	49,100	2,632.50	129,255,750	
イオンディライト	15,700	3,610.00	56,677,000	
ナック	6,200	1,053.00	6,528,600	
福井コンピュータホールディングス	8,700	2,618.00	22,776,600	
ダイセキ	29,900	4,330.00	129,467,000	
ステップ	5,400	1,986.00	10,724,400	
泉州電業	7,500	3,410.00	25,575,000	
元気寿司	8,400	3,505.00	29,442,000	
トラスコ中山	31,600	2,519.00	79,600,400	
ヤマダホールディングス	462,900	454.40	210,341,760	
オートバックスセブン	52,400	1,585.50	83,080,200	
モリト	10,800	1,330.00	14,364,000	
アークランズ	44,700	1,701.00	76,034,700	
ニトリホールディングス	54,800	18,060.00	989,688,000	
グルメ杵屋	12,100	1,073.00	12,983,300	
愛眼	6,200	190.00	1,178,000	
ケーユーホールディングス	7,100	1,151.00	8,172,100	
吉野家ホールディングス	55,400	3,312.00	183,484,800	
加藤産業	18,600	4,700.00	87,420,000	
北恵	2,100	880.00	1,848,000	
イノテック	9,500	1,827.00	17,356,500	
イエローハット	23,900	1,802.00	43,067,800	
松屋フーズホールディングス	7,100	5,900.00	41,890,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,400	3,920.00	36,848,000	
ＪＫホールディングス	11,600	1,080.00	12,528,000	
サガミホールディングス	22,600	1,470.00	33,222,000	
日伝	10,200	2,920.00	29,784,000	
関西フードマーケット	10,300	1,490.00	15,347,000	
ミロク情報サービス	13,000	1,811.00	23,543,000	
北沢産業	5,100	278.00	1,417,800	
杉本商事	7,300	2,291.00	16,724,300	
因幡電機産業	38,900	3,495.00	135,955,500	
王将フードサービス	11,200	8,180.00	91,616,000	
ミニストップ	11,000	1,569.00	17,259,000	
アークス	27,600	2,925.00	80,730,000	
バローホールディングス	28,800	2,562.00	73,785,600	
東テク	5,100	5,060.00	25,806,000	
ミスミグループ本社	227,200	2,508.50	569,931,200	
アルテック	4,500	244.00	1,098,000	
ベルク	7,500	6,300.00	47,250,000	
大　庄	6,300	1,270.00	8,001,000	
タキヒヨー	2,000	1,018.00	2,036,000	

ファーストリテイリング	67,700	36,620.00	2,479,174,000	
ソフトバンクグループ	703,700	6,431.00	4,525,494,700	
蔵王産業	1,500	2,521.00	3,781,500	
スズケン	57,300	4,848.00	277,790,400	
サンドラッグ	50,800	4,516.00	229,412,800	
サックスバー　ホールディングス	12,700	844.00	10,718,800	
ジェコス	8,900	1,098.00	9,772,200	
ヤマザワ	1,800	1,278.00	2,300,400	
やまや	1,700	3,110.00	5,287,000	
グローセル	15,500	679.00	10,524,500	
ベルーナ	36,200	623.00	22,552,600	
合計	220,224,100		501,152,764,250	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	13,869,463,623
コール・ローン	895,206,886
株式	1,209,456,597,946
投資信託受益証券	2,007,720,202
投資証券	23,510,599,732
派生商品評価勘定	447,947,257
未収配当金	1,116,644,735
差入委託証拠金	8,680,890,196
流動資産合計	1,259,985,070,577
資産合計	1,259,985,070,577
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,455,016
未払解約金	1,269,497,000
流動負債合計	1,322,952,016
負債合計	1,322,952,016
純資産の部	
元本等	
元本	160,807,419,421
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,097,854,699,140
元本等合計	1,258,662,118,561
純資産合計	1,258,662,118,561
負債純資産合計	1,259,985,070,577

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	136,103,425,952円
同期中追加設定元本額	75,001,343,868円
同期中一部解約元本額	50,297,350,399円

元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,128,184,039円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,531,018円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,233,160円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	15,948,412円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	21,267,245円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	19,283,292円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,642,057円
たわらノーロード　先進国株式	55,926,978,994円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	271,640,854円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,950,183,240円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	916,608,595円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	86,800,206円
たわらノーロード　バランス（標準型）	784,148,191円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,033,260,998円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	1,335円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	34,501,301円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	208,866,486円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	242,192,200円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	418,060,592円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,447円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	129,995円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	13,954,908円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,992,588円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	10,517,745円
たわらノーロード　全世界株式	1,459,470,314円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	56,556,941,029円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	3,246,655,594円
Ｏｎｅグローバルバランス	20,936,990円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	135,570,417円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	748,278,630円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,010,800,940円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	81,866,001円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	228,321,872円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	237,223,346円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,324,819円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	661,374,253円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	120,402,683円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	159,091,288円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	185,469,092円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	310,857,088円
投資のソムリエ	10,002,508,196円
クルーズコントロール	99,618,178円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	962,405,473円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	180,537,951円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	283,766,424円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,083,058,915円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,606,972,573円
ワールドアセットバランス（基本コース）	111,623,980円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	234,010,049円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	58,151,930円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	29,354,634円

リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	9,259,264円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	191,917,200円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	138,504,634円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	989,801,396円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	133,792,920円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	65,268,596円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	31,844,529円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	19,420,783円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	136,030,164円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,592,602円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	28,201,646円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	209,356円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	228,308円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	92,290円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	236,047円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	446,629円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	192,676円
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	340,931,490円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	34,996,421円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,105,981,067円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,645,900円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,234,342,586円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	312,798,526円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	768,989円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,524,946円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	351,579円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	4,253,427円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,656,355円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	37,663,527円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,470,764円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,966,412円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	964,562円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,957円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	759,522円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,616,979円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	108,374,161円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	198,222,031円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	691,557,102円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	30,683,582円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	25,068,627円

ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	170,764,485円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	5,515,438円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	136,121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）	62,876,119円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,834,053円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,042,352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）	38,465,370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）	76,368,544円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	14,184,867円
コア資産形成ファンド	7,538,079円
たわらノーロード　先進国株式（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	2,600,149,750円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	133,704,647円
たわらノーロード　先進国株式（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	7,847,856円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,672,117,081円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,924,685,550円
計	160,807,419,421円
２．　受益権の総数	160,807,419,421口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月16日から2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

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

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

株式関連

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

（注）時価の算定方法
株価指数先物取引
１．　原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。
３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

附属明細表
第１　有価証券明細表
（１）株式

2024年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,396,226	153.730	214,641,822.980	
	ABBOTT LABORATORIES	261,414	114.400	29,905,761.600	
	AES CORP	109,122	18.880	2,060,223.360	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	136,698	161.230	22,039,818.540	
	ADVANCED MICRO DEVICES	242,950	148.540	36,087,793.000	
	ADOBE INC	68,332	591.030	40,386,261.960	

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

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

HEICO CORP-CL A	11,614	135.190	1,570,096.660	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	207.090	1,955,343.780	
CUMMINS INC	21,250	239.220	5,083,425.000	
DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	46.270	1,101,503.620	
DR HORTON INC	45,784	154.520	7,074,543.680	
DANAHER CORP	105,610	229.640	24,252,280.400	
MOODY'S CORP	24,521	376.590	9,234,363.390	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	73.350	5,574,379.950	
TARGET CORP	69,096	144.090	9,956,042.640	
DEERE & CO	41,361	393.710	16,284,239.310	
MORGAN STANLEY	185,673	91.480	16,985,366.040	
REPUBLIC SERVICES INC	33,574	164.300	5,516,208.200	
COSTAR GROUP INC	61,975	82.710	5,125,952.250	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	695.910	2,593,656.570	
THE WALT DISNEY CO	275,728	89.290	24,619,753.120	
DOLLAR TREE INC	31,756	137.620	4,370,260.720	
DOVER CORP	20,350	147.170	2,994,909.500	
OMNICOM GROUP	30,586	88.230	2,698,602.780	
DTE ENERGY CO	30,044	110.830	3,329,776.520	
DUKE ENERGY CORP	118,123	99.280	11,727,251.440	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,701	161.040	2,850,569.040	
EBAY INC	75,181	42.560	3,199,703.360	
BANK OF AMERICA CORP	1,077,648	33.600	36,208,972.800	
CITIGROUP INC	288,199	53.020	15,280,310.980	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	87.750	1,473,322.500	
EATON CORP PLC	59,302	240.890	14,285,258.780	
CADENCE DESIGN SYS INC	40,689	263.260	10,711,786.140	
ECOLAB INC	38,151	197.390	7,530,625.890	
REVVITY INC	17,972	111.680	2,007,112.960	
ELECTRONIC ARTS INC	38,801	137.630	5,340,181.630	
SALESFORCE INC	146,338	264.130	38,652,255.940	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	328.300	1,107,027.600	
EMERSON ELECTRIC CO	84,776	94.770	8,034,221.520	
ATMOS ENERGY CORP	21,199	118.040	2,502,329.960	
ENTERGY CORP	30,736	104.540	3,213,141.440	
EOG RESOURCES INC	86,645	114.990	9,963,308.550	
EQUIFAX INC	18,730	244.830	4,585,665.900	
EQT CORP	59,729	37.710	2,252,380.590	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	135.670	4,863,226.820	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	125.080	2,803,668.200	
EXXON MOBIL CORP	600,687	98.690	59,281,800.030	
FMC CORP	17,711	59.510	1,053,981.610	
NEXTERA ENERGY INC	309,921	62.280	19,301,879.880	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	462.770	2,504,511.240	
FAIR ISAAC CORP	3,775	1,200.230	4,530,868.250	
ASSURANT INC	8,766	163.300	1,431,487.800	

FASTENAL CO	85,603	63.080	5,399,837.240	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	35.360	3,727,297.600	
M&T BANK CORP	24,958	136.840	3,415,252.720	
FISERV INC	91,718	135.400	12,418,617.200	
FORD MOTOR CO	585,908	11.830	6,931,291.640	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	29.080	1,380,631.160	
FREEPORT-MCMORAN INC	214,628	41.300	8,864,136.400	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,401.250	2,219,580.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,707	230.150	7,297,366.050	
GENERAL DYNAMICS CORP	34,634	251.250	8,701,792.500	
GENERAL MILLS INC	88,517	63.150	5,589,848.550	
GENUINE PARTS CO	20,769	137.670	2,859,268.230	
GILEAD SCIENCES INC	185,219	84.500	15,651,005.500	
GARTNER INC	11,988	441.560	5,293,421.280	
MCKESSON CORP	20,139	483.690	9,741,032.910	
NVIDIA CORP	371,467	543.500	201,892,314.500	
GRACO INC	23,985	83.300	1,997,950.500	
GENERAL ELECTRIC CO	164,658	129.700	21,356,142.600	
WW GRAINGER INC	6,777	830.830	5,630,534.910	
HALLIBURTON CO	139,251	34.070	4,744,281.570	
MONSTER BEVERAGE CORP	117,637	58.910	6,929,995.670	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	49,219	381.960	18,799,689.240	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,728	203.470	5,845,286.160	
HASBRO INC	16,359	50.750	830,219.250	
HENRY SCHEIN INC	17,431	74.730	1,302,618.630	
HEICO CORP	6,878	171.360	1,178,614.080	
HERSHEY FOODS CORP	22,500	189.640	4,266,900.000	
HP INC	134,136	30.340	4,069,686.240	
F5 INC	8,981	175.720	1,578,141.320	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	91.480	1,658,075.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	221.660	1,687,940.900	
JUNIPER NETWORKS INC	57,881	37.590	2,175,746.790	
HOLOGIC INC	38,399	71.830	2,758,200.170	
HOME DEPOT INC	150,144	356.800	53,571,379.200	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	95.890	2,523,728.910	
HORMEL FOODS CORP	49,054	31.890	1,564,332.060	
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	29.250	2,859,948.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	444.070	2,183,492.190	
HUBBELL INC	7,820	325.690	2,546,895.800	
HUMANA INC	18,641	459.080	8,557,710.280	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	192.970	2,368,899.720	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	215,385	12.930	2,784,928.050	
BIOGEN INC	21,910	254.230	5,570,179.300	
IDEX CORP	11,045	209.620	2,315,252.900	

ILLINOIS TOOL WORKS	44,869	253.980	11,395,828.620	
INTUIT INC	42,167	608.700	25,667,052.900	
IDEXX LABORATORIES INC	12,500	554.240	6,928,000.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	33,856	245.880	8,324,513.280	
INTEL CORP	629,190	47.470	29,867,649.300	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	80.540	3,301,576.220	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	37.560	1,658,386.680	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	32.580	1,761,372.540	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	167.610	1,987,351.770	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	129.520	2,536,778.720	
INCYTE CORP	31,654	64.140	2,030,287.560	
JOHNSON & JOHNSON	361,496	161.870	58,515,357.520	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	82.430	3,763,671.370	
KLA CORPORATION	20,432	556.090	11,362,030.880	
DEVON ENERGY CORP	96,985	43.940	4,261,520.900	
KELLANOVA	42,451	55.790	2,368,341.290	
KEYCORP	144,072	14.460	2,083,281.120	
KIMBERLY-CLARK CORP	50,460	123.270	6,220,204.200	
BLACKROCK INC/NEW YORK	22,139	792.360	17,542,058.040	
KROGER CO	103,385	46.140	4,770,183.900	
LAM RESEARCH CORP	20,026	749.690	15,013,291.940	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	440.830	2,892,285.630	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	165.950	2,232,193.450	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	66.300	1,343,238.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	116.080	2,706,173.040	
LENNAR CORP	37,667	153.350	5,776,234.450	
ELI LILLY & CO	121,042	630.190	76,279,457.980	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	44.130	1,242,524.280	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	110,884	161.220	17,876,718.480	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,825	131.090	5,876,109.250	
LOCKHEED MARTIN CORP	33,842	455.400	15,411,646.800	
LOEWS CORP	30,289	70.970	2,149,610.330	
LOWE'S COS INC	86,951	220.210	19,147,479.710	
DOMINION ENERGY INC	126,501	47.930	6,063,192.930	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	43.490	1,757,039.490	
MCCORMICK & CO INC	35,510	66.270	2,353,247.700	
MCDONALD'S CORPORATION	109,514	294.090	32,206,972.260	
S&P GLOBAL INC	48,610	433.130	21,054,449.300	
EVEREST GROUP LTD	6,670	370.500	2,471,235.000	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,410.000	2,838,330.000	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	91,510	76.120	6,965,741.200	
MARSH & MCLENNAN COS	74,055	192.440	14,251,144.200	
MASCO CORP	34,561	68.180	2,356,368.980	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,365	499.940	4,681,938.100	
METLIFE INC	97,405	69.300	6,750,166.500	
MEDTRONIC PLC	202,117	87.080	17,600,348.360	
CVS HEALTH CORP	197,356	79.240	15,638,489.440	
MERCK & CO.INC.	380,439	118.860	45,218,979.540	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	75.610	4,933,552.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,876	225.370	2,901,864.120	
MICROSOFT CORP	1,060,970	382.770	406,107,486.900	
MICRON TECH INC	163,017	82.380	13,429,340.460	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	81,668	85.440	6,977,713.920	
3M CO	82,577	108.300	8,943,089.100	
ENTEGRIS INC	20,987	112.940	2,370,271.780	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	213.140	1,635,636.360	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,847	315.040	7,827,798.880	
ILLUMINA INC	24,379	140.630	3,428,418.770	
XCEL ENERGY INC	82,777	62.720	5,191,773.440	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	132.390	1,934,615.070	
NETAPP INC	32,785	86.660	2,841,148.100	
NEWMONT CORP	173,608	37.950	6,588,423.600	
NVR INC	483	7,147.310	3,452,150.730	
NIKE INC-CL B	182,817	103.770	18,970,920.090	
NORDSON CORP	7,548	250.620	1,891,679.760	
NORFOLK SOUTHERN CORP	34,140	228.850	7,812,939.000	
EVERSOURCE ENERGY	51,861	58.360	3,026,607.960	
NISOURCE INC	64,543	27.340	1,764,605.620	
NORTHERN TRUST CORP	32,868	84.150	2,765,842.200	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,526	471.950	10,159,195.700	
WELLS FARGO & CO	549,951	49.080	26,991,595.080	
NUCOR CORP	37,496	168.860	6,331,574.560	
CHENIERE ENERGY INC	36,422	167.140	6,087,573.080	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,630	128.940	7,430,812.200	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,774	56.800	5,667,163.200	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,854	391.020	5,808,211.080	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	936.550	8,507,620.200	
ORACLE CORP	246,970	103.920	25,665,122.400	
PACCAR INC	77,744	94.600	7,354,582.400	
PTC INC	18,085	169.100	3,058,173.500	

EXELON CORP	147,025	36.640	5,386,996.000	
PARKER HANNIFIN CORP	19,211	460.780	8,852,044.580	
PAYCHEX INC	49,152	118.890	5,843,681.280	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,491	276.790	2,903,803.890	
PPL CORPORATION	113,687	27.610	3,138,898.070	
PEPSICO INC	206,840	166.920	34,525,732.800	
PENTAIR PLC	25,545	70.740	1,807,053.300	
PFIZER INC	849,236	28.990	24,619,351.640	
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	38.660	1,558,732.540	
CONOCOPHILLIPS	179,242	111.180	19,928,125.560	
PG&E CORP	306,139	18.160	5,559,484.240	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34,773	221.020	7,685,528.460	
ALTRIA GROUP INC	263,679	41.060	10,826,659.740	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	59,805	155.180	9,280,539.900	
BROWN & BROWN INC	36,907	72.940	2,691,996.580	
GARMIN LTD	23,281	123.250	2,869,383.250	
PPG INDUSTRIES INC	35,748	147.290	5,265,322.920	
COSTCO WHOLESALE CORP	66,410	672.760	44,677,991.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	107.390	3,682,725.270	
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	137.100	2,272,295.400	
PROCTER & GAMBLE CO	353,784	149.940	53,046,372.960	
PROGRESSIVE CORP	87,083	165.510	14,413,107.330	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,243	62.010	4,603,808.430	
PULTE GROUP INC	33,950	105.210	3,571,879.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,240	133.270	4,962,974.800	
QUALCOMM INC	167,820	139.310	23,379,004.200	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,141	110.940	3,232,902.540	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	70.110	1,826,014.950	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	8,747	277.000	2,422,919.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,052	906.160	14,545,680.320	
REPLIGEN CORP	8,576	178.160	1,527,900.160	
RESMED INC	22,899	177.290	4,059,763.710	
US BANCORP	229,227	43.400	9,948,451.800	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,309	76.960	4,333,540.640	
ROSS STORES INC	50,878	135.960	6,917,372.880	
ROLLINS INC	45,708	43.290	1,978,699.320	
ROPER TECHNOLOGIES INC	15,771	530.300	8,363,361.300	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,327	302.070	5,233,966.890	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	34,772	123.600	4,297,819.200	
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	107.060	2,061,761.480	
ACCENTURE PLC-CL A	94,821	345.330	32,744,535.930	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	202,099	73.080	14,769,394.920	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	245.440	3,980,300.480	
AXON ENTERPRISE INC	11,039	249.020	2,748,931.780	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	34,835	193.090	6,726,290.150	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	89,354	62.450	5,580,157.300	
BOOKING HOLDINGS INC	5,368	3,521.150	18,901,533.200	
SCHLUMBERGER LTD	212,211	48.450	10,281,622.950	
SCHWAB (CHARLES) CORP	224,033	65.820	14,745,852.060	
POOL CORP	5,406	389.850	2,107,529.100	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	123.230	3,957,408.220	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	62.900	910,603.300	
ELEVANCE HEALTH INC	35,171	480.240	16,890,521.040	
CENCORA INC	25,701	216.130	5,554,757.130	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	79.000	2,811,689.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	36,435	298.400	10,872,204.000	
CENTENE CORP	82,487	78.410	6,467,805.670	
SMITH (A.O.) CORP	19,563	80.480	1,574,430.240	
SNAP-ON INC	8,204	282.490	2,317,547.960	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,392	103.720	5,641,538.240	
EDISON INTERNATIONAL	57,612	72.330	4,167,075.960	
SOUTHERN CO	166,722	71.830	11,975,641.260	
TRUIST FINANCIAL CORP	198,729	37.730	7,498,045.170	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	29.710	585,287.000	
AT&T INC	1,063,626	16.870	17,943,370.620	
CHEVRON CORP	272,487	144.500	39,374,371.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	98.170	2,217,856.640	
STATE STREET CORP	50,416	76.600	3,861,865.600	
STARBUCKS CORP	170,073	93.500	15,901,825.500	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	112.840	2,588,211.080	
STRYKER CORP	51,849	307.780	15,958,085.220	
NETFLIX INC	66,811	478.330	31,957,705.630	
GEN DIGITAL INC	92,583	22.820	2,112,744.060	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	56.870	1,558,238.000	
SYNOPSYS INC	22,666	505.180	11,450,409.880	
SYSCO CORP	76,419	75.030	5,733,717.570	
INTUITIVE SURGICAL INC	53,463	364.450	19,484,590.350	
TELEFLEX INC	6,985	248.500	1,735,772.500	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	11.490	1,944,682.500	
TERADYNE INC	22,066	104.880	2,314,282.080	
TEXAS INSTRUMENTS INC	137,188	167.250	22,944,693.000	

TEXTRON INC	29,841	78.190	2,333,267.790	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	58,046	543.930	31,572,960.780	
GLOBE LIFE INC	12,153	120.500	1,464,436.500	
TORO CO	14,644	90.880	1,330,846.720	
DAVITA INC	6,813	109.640	746,977.320	
TRACTOR SUPPLY CO	16,808	220.030	3,698,264.240	
BIO-TECHNE CORP	25,934	73.150	1,897,072.100	
TRIMBLE INC	37,504	50.950	1,910,828.800	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,175	418.400	2,583,620.000	
TYSON FOODS INC	41,316	54.500	2,251,722.000	
MARATHON OIL CORP	92,952	22.850	2,123,953.200	
UNION PACIFIC CORP	91,691	239.000	21,914,149.000	
RTX CORP	217,454	86.080	18,718,440.320	
UNITEDHEALTH GROUP INC	139,147	537.640	74,810,993.080	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	156.860	1,269,938.560	
VF CORP	51,762	17.300	895,482.600	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	14.120	1,148,323.120	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	38,348	423.760	16,250,348.480	
VULCAN MATERIALS CO	20,095	226.110	4,543,680.450	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	24.680	2,643,820.320	
WALMART INC	222,066	161.290	35,817,025.140	
WASTE MANAGEMENT INC	60,476	179.180	10,836,089.680	
WATERS CORP	8,786	307.600	2,702,573.600	
WATSCO INC	4,889	411.270	2,010,699.030	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,626	357.160	3,795,182.160	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	129.500	2,020,718.000	
VAIL RESORTS INC	6,523	214.780	1,401,009.940	
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	50.510	2,497,770.010	
WABTEC CORP	25,714	126.240	3,246,135.360	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	104.330	2,319,777.550	
WYNN RESORTS LTD	15,379	93.630	1,439,935.770	
NASDAQ INC	52,969	56.890	3,013,406.410	
CME GROUP INC	54,132	197.830	10,708,933.560	
WILLIAMS COS INC	180,781	35.230	6,368,914.630	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	140.340	1,200,047.340	
LKQ CORP	37,072	47.020	1,743,125.440	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	51.910	2,103,600.840	
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	85.590	4,098,220.380	
CARMAX INC	22,414	72.580	1,626,808.120	
TJX COMPANIES INC	172,469	94.140	16,236,231.660	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	255.270	1,987,276.950	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.450	538,369.050	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	40.460	951,942.880	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	196.610	3,788,871.310	
CBRE GROUP INC	44,502	86.650	3,856,098.300	
REGIONS FINANCIAL CORP	133,681	18.920	2,529,244.520	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	414.130	2,127,385.810	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,127	589.190	4,199,157.130	
WESTLAKE CORP	6,030	135.420	816,582.600	
T-MOBILE US INC	80,697	163.290	13,177,013.130	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	49.290	2,357,047.800	
MOSAIC CO/THE	48,502	33.670	1,633,062.340	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	272.000	1,666,272.000	
CELANESE CORP	16,273	148.990	2,424,514.270	
DEXCOM INC	58,553	128.000	7,494,784.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	167.300	3,271,384.200	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	151.850	3,337,359.300	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	78.080	2,418,059.520	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	377.990	5,872,452.640	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	84,672	127.650	10,808,380.800	
LIVE NATION	23,597	89.500	2,111,931.500	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,117	2,245.000	9,242,665.000	
TRANSDIGM GROUP INC	8,166	1,015.000	8,288,490.000	
MASTERCARD INC	126,146	428.270	54,024,547.420	
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	59.790	1,412,419.170	
OWENS CORNING	13,227	150.780	1,994,367.060	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	109.710	1,981,472.310	
AERCAP HOLDINGS NV	30,064	74.250	2,232,252.000	
FIRST SOLAR INC	15,579	162.330	2,528,939.070	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,070	201.970	3,447,627.900	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,263	342.380	2,486,705.940	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	89.330	1,884,327.020	
DELTA AIR LINES INC	21,592	42.110	909,239.120	
INSULET CORP	10,158	205.070	2,083,101.060	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	111.030	4,351,043.640	
TE CONNECTIVITY LTD	47,054	133.170	6,266,181.180	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,255	484.100	8,353,145.500	
MERCADOLIBRE INC	6,748	1,598.160	10,784,383.680	
ULTA BEAUTY INC	7,263	480.910	3,492,849.330	
MSCI INC	11,948	546.660	6,531,493.680	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	233,121	94.470	22,022,940.870	
VISA INC	241,677	264.560	63,938,067.120	
KEURIG DR PEPPER INC	160,760	31.770	5,107,345.200	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	27,995	133.620	3,740,691.900	
MARATHON PETROLEUM CORP	58,920	152.840	9,005,332.800	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	78.400	1,680,112.000	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	298,312	17.950	5,354,700.400	
XYLEM INC	36,891	112.240	4,140,645.840	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,272	94.330	3,515,867.760	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	252.820	1,638,526.420	
SPLUNK INC	22,702	152.490	3,461,827.980	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	299.640	2,445,661.680	
HCA HEALTHCARE INC	30,702	282.500	8,673,315.000	
VERISK ANALYTICS INC	21,663	233.960	5,068,275.480	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,706	120.250	1,287,396.500	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,295	280.260	2,885,276.700	
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,938	211.290	8,227,210.020	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,242	127.220	2,447,967.240	
TARGA RESOURCES CORP	33,263	83.810	2,787,772.030	
LEAR CORP	9,398	134.760	1,266,474.480	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,608	175.610	2,740,920.880	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	60.670	2,080,677.650	
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	134.060	4,483,502.640	
FORTINET INC	100,599	61.370	6,173,760.630	
HYATT HOTELS CORP	6,647	129.190	858,725.930	
TESLA INC	429,981	233.940	100,589,755.140	
ENPHASE ENERGY INC	18,600	117.540	2,186,244.000	
GENERAL MOTORS CO	208,056	36.310	7,554,513.360	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	33.960	1,332,250.800	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	234.170	2,785,452.150	
APTIV PLC	43,097	82.920	3,573,603.240	
PHILLIPS 66	68,358	129.410	8,846,208.780	
META PLATFORMS INC	334,116	370.470	123,779,954.520	
IQVIA HOLDINGS INC	27,848	217.130	6,046,636.240	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,850	151.360	3,761,296.000	
SERVICENOW INC	30,797	714.300	21,998,297.100	
PALO ALTO NETWORKS INC	46,854	316.090	14,810,080.860	
WORKDAY INC	31,060	276.810	8,597,718.600	
ABBVIE INC	264,718	164.890	43,649,351.020	
ZOETIS INC	68,687	198.770	13,652,914.990	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	24.190	1,311,364.090	
CDW CORP	20,262	220.270	4,463,110.740	
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	55.570	3,507,022.700	

TWILIO INC	25,710	71.260	1,832,094.600	
SNAP INC	152,250	17.370	2,644,582.500	
TRADE DESK INC A	66,855	68.480	4,578,230.400	
OKTA INC	21,831	83.950	1,832,712.450	
BAKER HUGHES CO	152,160	31.230	4,751,956.800	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	107.180	2,334,916.300	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	11.820	1,914,390.840	
BROADCOM INC	66,816	1,080.570	72,199,365.120	
ARES MANAGEMENT CORP	23,161	118.670	2,748,515.870	
MONGODB INC	10,906	393.150	4,287,693.900	
BURLINGTON STORES INC	10,565	196.900	2,080,248.500	
VEEVA SYSTEMS INC	23,273	193.890	4,512,401.970	
EVERGY INC	33,192	54.080	1,795,023.360	
ALLEGION PLC	13,423	122.100	1,638,948.300	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	22,002	65.340	1,437,610.680	
STERIS PLC	14,158	223.990	3,171,250.420	
DOCUSIGN INC	26,362	56.110	1,479,171.820	
WIX.COM LTD	8,997	122.180	1,099,253.460	
DROPBOX INC	41,801	30.210	1,262,808.210	
KKR & CO INC	90,373	82.420	7,448,542.660	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	48.230	243,561.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	68.180	2,308,370.260	
MODERNA INC	50,006	109.460	5,473,656.760	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	182.520	7,343,144.640	
CIGNA GROUP	45,163	307.720	13,897,558.360	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,669	78.250	3,025,849.250	
DOW INC	106,037	53.380	5,660,255.060	
OVINTIV INC	39,160	41.340	1,618,874.400	
AMCOR PLC	223,348	9.760	2,179,876.480	
PINTEREST INC	90,936	37.760	3,433,743.360	
FOX CORP-A	36,501	30.670	1,119,485.670	
FOX CORP-B	27,507	28.500	783,949.500	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	33,813	282.040	9,536,618.520	
AVANTOR INC	97,157	22.480	2,184,089.360	
DYNATRACE INC	39,362	54.870	2,159,792.940	
CLOUDFLARE INC	39,310	80.970	3,182,930.700	
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	93.850	1,587,754.300	
CARRIER GLOBAL CORP	124,379	57.040	7,094,578.160	
OTIS WORLDWIDE CORP	62,600	87.000	5,446,200.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	276,804	62.410	17,275,337.640	
CORTEVA INC	108,001	46.050	4,973,446.050	
MATCH GROUP INC	44,764	38.780	1,735,947.920	
FERGUSON PLC	30,868	187.140	5,776,637.520	
BILL HOLDINGS INC	16,243	76.390	1,240,802.770	
BLACKSTONE INC	105,031	121.530	12,764,417.430	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,809	159.580	927,000.220	
CARLYLE GROUP INC	34,847	39.500	1,376,456.500	

DATADOG INC	38,635	120.190	4,643,540.650	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	82.660	2,553,367.400	
VERTIV HOLDINGS CO	53,234	48.790	2,597,286.860	
INGERSOLL RAND INC	61,976	76.290	4,728,149.040	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	62,373	76.170	4,750,951.410	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	202.000	1,806,082.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	19.070	1,781,633.820	
DRAFTKINGS INC	63,900	33.570	2,145,123.000	
UNITY SOFTWARE INC	40,967	37.130	1,521,104.710	
AON PLC	30,296	299.300	9,067,592.800	
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	10.970	3,855,088.370	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,512.290	1,370,134.740	
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	47.570	1,599,969.380	
COINBASE GLOBAL INC	26,305	151.290	3,979,683.450	
UIPATH INC	53,439	22.740	1,215,202.860	
AIRBNB INC	64,456	139.760	9,008,370.560	
CONSTELLATION ENERGY CORP	48,214	115.850	5,585,591.900	
MONDAY.COM LTD	3,043	192.160	584,742.880	
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	28.780	1,789,338.940	
ROBLOX CORP	59,573	41.780	2,488,959.940	
VIATRIS INC	184,148	12.100	2,228,190.800	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	45.360	1,569,637.440	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	77.180	1,222,994.280	
HF SINCLAIR CORP	20,299	52.440	1,064,479.560	
SNOWFLAKE INC	42,608	197.400	8,410,819.200	
DOORDASH INC	39,376	105.590	4,157,711.840	
ARISTA NETWORKS INC	39,238	249.230	9,779,286.740	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	59,548	96.720	5,759,482.560	
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	39.460	627,137.780	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	273,108	16.790	4,585,483.320	
FNF GROUP	38,907	49.580	1,929,009.060	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	131.950	2,470,499.850	
MARVELL TECHNOLOGY INC	129,101	63.430	8,188,876.430	
APA CORP	49,146	32.570	1,600,685.220	
CONFLUENT INC	27,524	22.670	623,969.080	
LINDE PLC	73,237	405.880	29,725,433.560	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	12.140	893,091.240	
LUCID GROUP INC	143,927	3.410	490,791.070	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	64.580	773,732.980	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	201.770	750,786.170	
TOAST INC	45,399	19.100	867,120.900	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.320	927,989.800	

	CATALENT INC	27,357	50.360	1,377,698.520	
	SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	37.940	2,606,515.940	
	VERALTO CORP	32,610	76.430	2,492,382.300	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	19,871	30.600	608,052.600	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE	28,191	61.890	1,744,740.990	
	BUNGE GLOBAL SA	21,715	94.910	2,060,970.650	
	KENVUE INC	264,038	21.770	5,748,107.260	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	33.370	2,436,443.810	
	CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	218.800	1,487,621.200	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	153.000	4,240,089.000	
	HUBSPOT INC	6,836	569.890	3,895,768.040	
	QORVO INC	14,144	104.490	1,477,906.560	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,444	76.750	1,415,577.000	
	LIBERTY GLOBAL LTD	36,034	19.640	707,707.760	
	GODADDY INC	19,713	104.700	2,063,951.100	
	ETSY INC	18,558	74.720	1,386,653.760	
	TRANSUNION	31,262	67.310	2,104,245.220	
	ALBERTSONS COS INC	54,086	23.050	1,246,682.300	
	BLOCK INC	84,306	67.900	5,724,377.400	
	DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	76.180	5,198,142.300	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	64.960	2,014,539.520	
	WESTROCK CO	34,286	41.860	1,435,211.960	
	KRAFT HEINZ CO	129,447	37.890	4,904,746.830	
	FORTIVE CORP	50,061	71.820	3,595,381.020	
	WASTE CONNECTIONS INC	38,848	148.640	5,774,366.720	
	ALPHABET INC-CL A	894,177	142.280	127,223,503.560	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	186,711	16.430	3,067,661.730	
	PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	60.960	9,662,586.720	
	SEA LTD ADR	58,070	38.390	2,229,307.300	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	32.770	1,845,901.330	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	54.600	1,221,620.400	
	ALPHABET INC-CL C	783,554	143.800	112,675,065.200	
	ZSCALER INC	14,051	225.400	3,167,095.400	
	ATLASSIAN CORP PLC	23,713	244.210	5,790,951.730	
	ROKU INC	19,331	89.690	1,733,797.390	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,042	367.000	5,153,414.000	
	VISTRA CORP	49,633	38.460	1,908,885.180	
アメリカ・ドル　小計		51,008,469		6,201,421,987.780 (903,237,112,519)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	15.830	970,299.850	

ASHTEAD GROUP	66,851	49.690	3,321,826.190	
SEVERN TRENT PLC	45,548	26.200	1,193,357.600	
BARCLAYS PLC	2,229,023	1.526	3,401,489.090	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	5.534	687,300.660	
BT GROUP PLC	904,198	1.166	1,054,294.860	
BUNZL PLC	46,691	31.960	1,492,244.360	
CRH PLC	108,593	54.120	5,877,053.160	
AVIVA PLC	429,205	4.274	1,834,422.170	
CRODA INTERNATIONAL	20,573	46.120	948,826.760	
DIAGEO PLC	333,830	27.875	9,305,511.250	
SCHRODERS PLC	110,366	4.232	467,068.910	
DCC PLC	17,471	56.620	989,208.020	
NATIONAL GRID PLC	547,462	10.685	5,849,631.470	
KINGFISHER PLC	336,026	2.246	754,714.390	
BAE SYSTEMS PLC	457,388	11.555	5,285,118.340	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	314,741	23.525	7,404,282.020	
HALMA PLC	51,066	21.770	1,111,706.820	
NEXT PLC	18,588	85.440	1,588,158.720	
IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	18.690	2,358,285.510	
ANGLO AMERICAN PLC	193,117	18.232	3,520,909.140	
COMPASS GROUP PLC	259,074	21.840	5,658,176.160	
HSBC HOLDINGS PLC	2,924,664	6.307	18,445,855.840	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.494	2,135,859.100	
CENTRICA PLC	793,776	1.544	1,225,590.140	
UNILEVER PLC	382,437	38.320	14,654,985.840	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.540	954,597.260	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	23.360	1,285,804.480	
PEARSON PLC	84,159	9.800	824,758.200	
PERSIMMON PLC	56,989	14.785	842,582.360	
PRUDENTIAL PLC	418,146	8.388	3,507,408.640	
RIO TINTO PLC	167,240	55.050	9,206,562.000	
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.686	2,457,871.450	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	107,096	56.080	6,005,943.680	
RELX PLC	280,647	31.620	8,874,058.140	
RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.139	1,551,483.450	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,221,103	3.092	3,775,650.470	
NATWEST GROUP PLC	896,355	2.151	1,928,059.600	
ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	6.328	563,710.890	
SSE PLC	168,922	18.630	3,147,016.860	
BP PLC	2,571,529	4.564	11,736,458.350	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	11.585	1,763,190.660	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.915	874,420.920	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	99.960	1,074,669.960	

	STANDARD CHARTERED PLC	362,528	6.264	2,270,875.390	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,179,291	0.469	4,305,087.470	
	TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.484	845,676.690	
	TESCO PLC	1,030,735	2.964	3,055,098.540	
	3I GROUP PLC	139,893	22.970	3,213,342.210	
	SMITH & NEPHEW PLC	125,930	10.785	1,358,155.050	
	GSK PLC	626,067	15.708	9,834,260.430	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63,356	90.920	5,760,327.520	
	WPP PLC	142,785	7.594	1,084,309.290	
	ASTRAZENECA PLC	232,839	109.000	25,379,451.000	
	WHITBREAD PLC	31,475	35.500	1,117,362.500	
	INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.900	999,956.100	
	BURBERRY GROUP PLC	52,229	14.030	732,772.870	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	71.860	1,931,165.640	
	SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.865	761,537.050	
	ADMIRAL GROUP PLC	40,084	25.690	1,029,757.960	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	48.980	807,631.220	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	18.905	348,891.770	
	ABRDN PLC	285,831	1.706	487,627.680	
	EXPERIAN PLC	140,133	31.450	4,407,182.850	
	MONDI PLC	74,310	14.740	1,095,329.400	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.376	272,484.190	
	OCADO GROUP PLC	69,766	6.858	478,455.220	
	INFORMA PLC	223,961	7.852	1,758,541.770	
	GLENCORE PLC	1,570,188	4.479	7,032,872.050	
	ENTAIN PLC	96,924	9.516	922,328.780	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	23.180	719,391.300	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	5.174	702,774.070	
	M&G PLC	270,401	2.245	607,050.240	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	14.640	411,018.000	
	WISE PLC	96,207	8.850	851,431.950	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.133	432,886.440	
	HALEON PLC	836,729	3.372	2,821,450.180	
	SHELL PLC	993,556	24.475	24,317,283.100	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	7.100	1,016,634.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	5.806	1,254,815.940	
イギリス・ポンド　小計		40,717,305		276,335,640.400 (51,307,238,353)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	31.720	5,944,454.880	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	27.900	6,670,415.700	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	774.200	2,578,086.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	17.850	2,908,550.400	
	ICL GROUP LTD	103,067	18.020	1,857,267.340	
	NICE LTD	9,053	786.500	7,120,184.500	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	136.700	4,024,994.800	
	AZRIELI GROUP	4,672	238.400	1,113,804.800	
イスラエル・シュケル　小計		738,997		32,217,758.420 (1,253,702,521)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	51.160	1,448,134.960	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	520,190	22.960	11,943,562.400	
	FORTESCUE LTD	253,090	27.560	6,975,160.400	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.900	2,339,426.700	
	ASX LTD	31,215	62.840	1,961,550.600	
	BHP GROUP LTD	757,775	47.860	36,267,111.500	
	AMPOL LTD	31,828	36.440	1,159,812.320	
	COMPUTERSHARE LT	91,624	24.670	2,260,364.080	
	CSL LIMITED	72,171	291.860	21,063,828.060	
	REA GROUP LTD	9,317	179.450	1,671,935.650	
	TRANSURBAN GROUP	476,258	13.800	6,572,360.400	
	COCHLEAR LTD	10,446	297.240	3,104,969.040	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	8.330	2,146,574.360	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	246,769	112.040	27,647,998.760	
	RIO TINTO LIMITED	56,991	128.900	7,346,139.900	
	APA GROUP	164,300	8.550	1,404,765.000	
	ARISTOCRAT LEISU	86,829	40.100	3,481,842.900	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.680	2,045,265.760	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	54.440	3,308,155.480	
	IGO LTD	91,947	7.770	714,428.190	
	ORICA LTD	63,862	15.870	1,013,489.940	
	BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	22.090	1,691,806.830	
	MACQUARIE GROUP LTD	56,701	180.260	10,220,922.260	
	SUNCORP GROUP LTD	199,628	13.600	2,714,940.800	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	465,095	30.720	14,287,718.400	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.430	611,738.370	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	219,807	14.960	3,288,312.720	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	12.690	2,063,762.010	
	REECE LTD	31,558	21.960	693,013.680	
	SANTOS LTD	478,809	7.500	3,591,067.500	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	31.820	2,065,022.540	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	32.420	1,277,996.400	
	WESFARMERS LTD	172,824	57.000	9,850,968.000	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	282,153	30.880	8,712,884.640	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	183,840	36.790	6,763,473.600	

	SEEK LTD	58,513	25.950	1,518,412.350	
	MINERAL RESOURCES LTD	28,865	63.000	1,818,495.000	
	BRAMBLES LTD	220,767	13.690	3,022,300.230	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	3.690	1,492,590.240	
	CAR GROUP LTD	58,310	30.560	1,781,953.600	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.800	846,826.200	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	10.070	1,358,543.700	
	XERO LTD	23,149	109.280	2,529,722.720	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	20.750	932,152.250	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.550	1,325,278.500	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.450	1,273,338.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	443,450	25.830	11,454,313.500	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.660	1,510,668.660	
	SOUTH32 LTD(AUD)	682,738	3.380	2,307,654.440	
	COLES GROUP LTD	197,589	16.030	3,167,351.670	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	71.880	1,531,762.800	
オーストラリア・ドル　小計		10,297,449		251,581,868.010 (24,579,548,505)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	75,291	69.630	5,242,512.330	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	23.220	6,211,233.900	
	BANK OF MONTREAL	109,727	127.750	14,017,624.250	
	BANK OF NOVA SCOTIA	183,639	63.600	11,679,440.400	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	101.090	5,226,959.540	
	BCE INC	14,197	54.720	776,859.840	
	BROOKFIELD CORP	211,045	53.150	11,217,041.750	
	SAPUTO INC	34,582	27.150	938,901.300	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	8.830	815,106.130	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	110.000	1,265,880.000	
	CGI INC	31,091	141.790	4,408,392.890	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	56.960	1,199,463.680	
	CAE INC	40,808	28.280	1,154,050.240	
	CAMECO CORP	66,084	60.420	3,992,795.280	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	63.510	3,389,846.250	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	136,114	63.070	8,584,709.980	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,344	86.350	14,191,104.400	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	144.040	1,283,540.440	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	32.220	526,152.600	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,693	166.400	13,926,515.200	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	42.080	1,268,375.360	
	OPEN TEXT CORP	40,459	55.620	2,250,329.580	
	EMPIRE CO LTD	20,608	35.050	722,310.400	
	KINROSS GOLD CORP	192,737	7.520	1,449,382.240	
	RB GLOBAL INC	26,641	87.620	2,334,284.420	

FORTIS INC	72,078	55.880	4,027,718.640	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	12.540	1,071,179.340	
TELUS CORP	31,890	24.460	780,029.400	
GREAT WEST LIFECO INC	43,551	43.320	1,886,629.320	
IMPERIAL OIL LTD	27,434	77.450	2,124,763.300	
ENBRIDGE INC	314,754	49.350	15,533,109.900	
IGM FINANCIAL INC	12,478	35.330	440,847.740	
MANULIFE FINANCIAL CORP	271,363	28.930	7,850,531.590	
LOBLAW CO LTD	24,803	127.590	3,164,614.770	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	116,251	80.360	9,341,930.360	
MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	75.980	3,212,358.420	
SUN LIFE FINANCIAL INC	84,814	68.480	5,808,062.720	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,133	1,250.850	3,918,913.050	
METRO INC	35,059	68.320	2,395,230.880	
EMERA INC	44,643	51.490	2,298,668.070	
ONEX CORP	10,157	92.380	938,303.660	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	20.110	1,113,551.030	
POWER CORP OF CANADA	89,864	38.390	3,449,878.960	
QUEBECOR INC-B	30,598	31.970	978,218.060	
ROYAL BANK OF CANADA	208,784	134.640	28,110,677.760	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	138,820	105.580	14,656,615.600	
STANTEC INC	18,358	107.610	1,975,504.380	
SUNCOR ENERGY INC	198,439	43.390	8,610,268.210	
LUNDIN MINING CORP	77,139	10.620	819,216.180	
TECK RESOURCES LTD-CL B	65,896	51.800	3,413,412.800	
THOMSON REUTERS CORP	24,837	193.620	4,808,939.940	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	115.430	1,511,786.710	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	270,486	81.900	22,152,803.400	
TC ENERGY CORP	157,154	53.060	8,338,591.240	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	114.140	924,762.280	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	166.990	1,643,014.610	
INTACT FINANCIAL CORP	26,758	205.010	5,485,657.580	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	66,562	64.570	4,297,908.340	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,041	3,477.600	10,575,381.600	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	141.910	4,174,992.200	
TOURMALINE OIL CORP	49,085	60.190	2,954,426.150	
KEYERA CORP	39,997	32.020	1,280,703.940	
PARKLAND CORP	15,665	45.060	705,864.900	
ALTAGAS LTD	47,249	28.620	1,352,266.380	
PEMBINA PIPELINE CORP	82,164	45.870	3,768,862.680	
DOLLARAMA INC	41,508	97.140	4,032,087.120	

	MEG ENERGY CORP	47,181	23.100	1,089,881.100	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	21.590	4,895,899.530	
	ARC RESOURCES LTD	96,301	20.540	1,978,022.540	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	25.160	859,264.320	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	22.230	1,139,131.890	
	TMX GROUP LTD	46,884	31.950	1,497,943.800	
	BRP INC	4,307	92.330	397,665.310	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	13.380	1,322,211.600	
	NUTRIEN LTD	77,339	71.300	5,514,270.700	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	178.930	2,073,977.630	
	WSP GLOBAL INC	17,782	187.800	3,339,459.600	
	IA FINANCIAL CORP INC	16,448	88.390	1,453,838.720	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	43.790	1,561,857.930	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	40.700	655,392.100	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	52.580	2,747,252.420	
	AIR CANADA	41,858	19.620	821,253.960	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	105.220	4,746,789.860	
	SHOPIFY INC	179,237	108.460	19,440,045.020	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	215.040	1,126,164.480	
	HYDRO ONE LTD	46,225	38.950	1,800,463.750	
カナダ・ドル　小計		6,122,743		382,461,881.870 (41,646,274,317)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.830	657,994.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	5.470	887,234.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	268,710	32.510	8,735,762.100	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,000	6.470	653,470.000	
	SEATRIUM LTD	7,235,222	0.111	803,109.640	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	28.770	445,935.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.780	1,368,222.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	1.000	761,193.000	
	KEPPEL LTD	184,900	6.960	1,286,904.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	502,098	12.830	6,441,917.340	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	2.380	3,191,175.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.540	1,595,760.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	28.230	5,407,908.180	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.230	271,628.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.460	894,410.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	3.010	1,219,922.900	
シンガポール・ドル　小計		12,026,309		34,622,545.560 (3,789,437,612)	

スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	81.280	1,929,099.520	
	NESTLE SA-REGISTERED	401,274	98.270	39,433,195.980	
	CIE FINANC RICHEMONT	77,733	112.300	8,729,415.900	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	105,427	253.900	26,767,915.300	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	206.800	1,098,314.800	
	SIKA INHABER	23,397	244.000	5,708,868.000	
	SGS SA-REG	22,978	70.320	1,615,812.960	
	NOVARTIS AG-REG SHS	307,129	91.550	28,117,659.950	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	129.900	757,317.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,325.000	609,500.000	
	CLARIANT AG-REG	22,909	11.500	263,453.500	
	SWISSCOM AG-REG	4,457	509.600	2,271,287.200	
	ABB LTD	238,635	36.350	8,674,382.250	
	ADECCO GROUP AG-REG	26,454	38.630	1,021,918.020	
	GEBERIT AG	5,105	516.200	2,635,201.000	
	LONZA GROUP AG-REG	10,855	364.300	3,954,476.500	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,250.000	1,404,250.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	103,000.000	1,648,000.000	
	GIVAUDAN-REG	1,392	3,396.000	4,727,232.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,160	435.900	9,659,544.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	273.800	1,316,978.000	
	HOLCIM LTD	77,519	64.560	5,004,626.640	
	TEMENOS GROUP	10,930	77.740	849,698.200	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	61.850	289,025.050	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	278.000	2,251,800.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	291.800	2,302,302.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,475	129.700	2,136,807.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	217.800	936,540.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	41.700	386,100.300	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	117.400	575,964.400	
	SCHINDLER NAMEN	4,209	195.000	820,755.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	587.400	2,645,062.200	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	108.700	532,956.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	657.000	817,965.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,356	89.800	1,199,368.800	
	AVOLTA AG	12,933	32.550	420,969.150	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,163.500	3,994,295.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	47.200	1,515,780.800	
	SWISS RE LTD	45,502	96.740	4,401,863.480	
	BKW AG	3,194	152.600	487,404.400	
	SIG GROUP AG	50,969	18.530	944,455.570	
	ALCON INC	74,922	68.560	5,136,652.320	
	SANDOZ GROUP AG	57,347	28.660	1,643,565.020	
	UBS GROUP AG	487,869	25.460	12,421,144.740	
	VAT GROUP AG	4,131	400.600	1,654,878.600	

スイス・フラン　小計		2,254,885		205,713,802.650 (35,228,488,704)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	396,072	163.750	64,856,790.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	141.150	34,139,809.350	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	63.200	26,417,600.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	229.600	5,913,348.000	
	LUNDBERGS B	14,872	537.400	7,992,212.800	
	SKF AB-B SHS	46,594	198.100	9,230,271.400	
	SANDVIK AB	169,218	210.100	35,552,701.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	141.850	31,540,063.800	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	174.450	7,664,809.650	
	SWEDBANK AB	132,581	206.000	27,311,686.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	145.000	13,455,275.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	218,846	109.200	23,897,983.200	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	253.800	6,141,452.400	
	VOLVO AB-B SHS	237,569	248.350	59,000,261.150	
	HOLMEN AB-B SHS	17,320	410.100	7,102,932.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	88.920	6,015,793.680	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	325.500	4,977,546.000	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	325.900	6,949,817.500	
	SAAB AB-B	11,789	650.600	7,669,923.400	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	97.120	7,389,375.200	
	INVESTOR AB-B SHS	271,548	229.100	62,211,646.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	167.740	17,557,178.060	
	ASSA ABLOY AB-B	153,368	283.300	43,449,154.400	
	TELIA CO AB	344,810	27.180	9,371,935.800	
	BOLIDEN AB	36,260	287.350	10,419,311.000	
	ALFA LAVAL AB	44,407	383.700	17,038,965.900	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	69.320	5,056,339.440	
	INDUTRADE AB	39,178	253.800	9,943,376.400	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	79.640	3,804,323.160	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	65.140	13,863,876.480	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	279.600	10,172,127.600	
	HEXAGON AB-B SHS	307,116	116.600	35,809,725.600	
	SAGAX AB	28,022	262.900	7,366,983.800	
	EPIROC AB-A	103,115	188.100	19,395,931.500	
	EPIROC AB-B	61,487	166.200	10,219,139.400	
	ESSITY AB-B	86,900	257.600	22,385,440.000	
	EQT AB	55,194	260.200	14,361,478.800	
	VOLVO CAR AB	63,710	30.790	1,961,630.900	
	BEIJER REF AB	50,493	126.600	6,392,413.800	
	LIFCO AB	39,631	247.400	9,804,709.400	
	EVOLUTION AB	28,266	1,170.000	33,071,220.000	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	254.600	7,036,634.800	

スウェーデン・クローナ　小計		4,709,855		763,913,195.370 (10,878,123,902)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	15,167	864.600	13,113,388.200	
	A P MOLLER A/S	663	12,955.000	8,589,165.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	12,730.000	6,912,390.000	
	DANSKE BANK A/S	102,303	190.600	19,498,951.800	
	GENMAB A/S	9,783	2,199.000	21,512,817.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	363.200	10,821,544.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,890.000	1,649,970.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	489,820	737.900	361,438,178.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	202.800	31,336,858.800	
	COLOPLAST-B	21,291	784.000	16,692,144.000	
	DSV A/S	28,190	1,234.500	34,800,555.000	
	DEMANT A/S	11,367	298.100	3,388,502.700	
	TRYG A/S	58,222	145.550	8,474,212.100	
	PANDORA A/S	12,473	998.200	12,450,548.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	16,295	553.200	9,014,394.000	
	ORSTED A/S	26,911	379.100	10,201,960.100	
デンマーク・クローネ　小計		978,217		569,895,579.300 (12,212,862,264)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.570	1,408,402.370	
	EBOS GROUP LTD	25,631	35.710	915,283.010	
	FISHER & PAYKEL	78,460	23.740	1,862,640.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	5.185	1,621,468.750	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.550	411,562.700	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.640	1,349,697.120	
ニュージーランド・ドル　小計		883,297		7,569,054.350 (687,497,207)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	186.700	13,651,130.600	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	66.120	14,624,553.840	
	TELENOR ASA	119,576	120.750	14,438,802.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	499.800	5,590,263.000	
	ORKLA ASA	116,068	82.000	9,517,576.000	
	EQUINOR ASA	129,895	313.150	40,676,619.250	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	353.300	7,007,352.200	
	AKER BP ASA	40,933	285.000	11,665,905.000	
	SALMAR ASA	12,897	584.800	7,542,165.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	182.800	4,701,798.800	
	ADEVINTA ASA	54,715	112.300	6,144,494.500	
	DNB BANK ASA	143,909	214.600	30,882,871.400	
ノルウェー・クローネ　小計		969,033		166,443,532.190 (2,341,860,498)	
ユーロ	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	27,104	148.650	4,029,009.600	
	KERRY GROUP PLC-A	25,025	76.700	1,919,417.500	

KINGSPAN GROUP PLC	21,860	73.900	1,615,454.000	
UMICORE	33,545	22.070	740,338.150	
AIR LIQUIDE	77,642	171.460	13,312,497.320	
AIRBUS SE	88,164	144.040	12,699,142.560	
AXA SA	271,713	29.535	8,025,043.450	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	98,192	28.880	2,835,784.960	
ADIDAS AG	24,550	179.380	4,403,779.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	19.735	2,853,937.550	
DASSAULT AVIATION SA	3,120	185.600	579,072.000	
DANONE	96,532	61.060	5,894,243.920	
SAFRAN SA	51,062	163.620	8,354,764.440	
INTESA SANPAOLO	2,330,103	2.748	6,403,123.040	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,783	99.900	4,973,321.700	
ACCOR SA	31,427	34.870	1,095,859.490	
BOUYGUES	29,123	35.570	1,035,905.110	
BNP PARIBAS	155,810	62.430	9,727,218.300	
THALES SA	15,023	138.400	2,079,183.200	
CAPGEMINI SA	25,063	182.450	4,572,744.350	
LOTUS BAKERIES NV	77	7,740.000	595,980.000	
UNICREDIT SPA	244,666	25.865	6,328,286.090	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,403	127.550	1,582,002.650	
D'IETEREN TRDG	2,736	172.900	473,054.400	
COMMERZBANK AG	158,792	11.495	1,825,314.040	
EIFFAGE	12,706	97.500	1,238,835.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	28.520	1,677,375.280	
PUBLICIS GROUPE	33,467	85.140	2,849,380.380	
IBERDROLA SA	899,504	11.605	10,438,743.920	
ENI SPA	353,207	14.884	5,257,132.980	
JERONIMO MARTINS	45,606	22.280	1,016,101.680	
KESKO OYJ-B	35,252	18.305	645,287.860	
KBC GROUPE	35,962	59.820	2,151,246.840	
HANNOVER RUECK SE	8,405	222.900	1,873,474.500	
WARTSILA OYJ	77,148	13.530	1,043,812.440	
L'OREAL	36,699	440.000	16,147,560.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	41,589	683.000	28,405,287.000	
GEA GROUP AG	25,513	36.220	924,080.860	
BOLLORE	114,808	5.715	656,127.720	
MEDIOBANCA SPA	86,792	11.235	975,108.120	
MICHELIN(CGDE)-B	98,359	31.350	3,083,554.650	
CONTINENTAL AG	17,635	74.220	1,308,869.700	
DEUTSCHE POST AG-REG	151,735	44.755	6,790,899.920	
OMV AG	23,354	38.500	899,129.000	
VERBUND AG	10,663	86.250	919,683.750	
PERNOD-RICARD	30,948	148.800	4,605,062.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	23,311	46.330	1,079,998.630	

RENAULT SA	27,902	35.905	1,001,821.310	
REPSOL SA	195,049	12.930	2,521,983.570	
REMY COINTREAU	2,866	95.280	273,072.480	
MERCK KGAA	18,505	143.050	2,647,140.250	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	69,501	62.770	4,362,577.770	
RWE AG	98,751	40.770	4,026,078.270	
SEB SA	2,596	111.400	289,194.400	
SOCIETE GENERALE-A	104,069	24.425	2,541,885.320	
VINCI S.A.	76,313	115.060	8,780,573.780	
SODEXO	12,910	103.850	1,340,703.500	
SOFINA	2,281	217.800	496,801.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	81,059	174.180	14,118,856.620	
VIVENDI SE	98,944	9.866	976,181.500	
SAP SE	157,400	142.040	22,357,096.000	
TELEFONICA S.A	755,720	3.710	2,803,721.200	
TOTALENERGIES SE	341,670	59.770	20,421,615.900	
E.ON SE	339,366	12.610	4,279,405.260	
VOEST-ALPINE AG	18,032	26.700	481,454.400	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	65.800	1,176,898.800	
SIEMENS AG-REG	113,016	160.780	18,170,712.480	
UPM-KYMMENE OYJ	77,973	34.520	2,691,627.960	
ING GROEP NV-CVA	540,815	12.934	6,994,901.210	
PUMA AG	17,210	47.480	817,130.800	
BAYER AG	147,329	34.760	5,121,156.040	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	12.205	1,171,435.900	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	73.660	1,781,909.060	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	119,618	62.960	7,531,149.280	
BASF SE	135,442	45.020	6,097,598.840	
BEIERSDORF AG	15,743	138.050	2,173,321.150	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	85.260	1,840,422.360	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	36.810	1,237,993.920	
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	445.350	2,962,022.850	
ORANGE	286,957	10.544	3,025,674.600	
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	39.270	2,516,421.600	
RANDSTAD NV	15,584	52.200	813,484.800	
ALLIANZ SE	61,413	242.200	14,874,228.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	4.578	2,313,908.890	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	26.695	3,915,275.560	
HERMES INTL	4,712	1,854.000	8,736,048.000	
ENDESA S.A.	50,946	18.970	966,445.620	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.814	565,280.380	
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	38.440	2,174,704.560	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,381	379.600	7,736,627.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	24.720	2,005,508.880	

DASSAULT SYSTEMES SA	101,597	42.765	4,344,795.700	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	39.430	1,373,583.480	
RHEINMETALL STAMM	6,662	306.000	2,038,572.000	
HEINEKEN NV	43,759	91.040	3,983,819.360	
AKZO NOBEL	26,032	70.260	1,829,008.320	
ASML HOLDING NV	60,741	651.400	39,566,687.400	
AEGON LTD	232,433	5.252	1,220,738.110	
VOLKSWAGEN AG	3,315	122.600	406,419.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	113.380	3,449,586.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	885,310	8.402	7,438,374.620	
KERING	11,443	381.700	4,367,793.100	
ACCIONA S.A.	5,005	128.600	643,643.000	
FORTUM OYJ	54,194	13.795	747,606.230	
AGEAS	24,086	39.900	961,031.400	
UCB SA	16,732	82.580	1,381,728.560	
NEMETSCHEK SE	10,222	75.620	772,987.640	
CARREFOUR SA	90,642	16.490	1,494,686.580	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.920	475,864.840	
NOKIA OYJ	827,068	3.190	2,638,346.920	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	121,772	21.895	2,666,197.940	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	130.500	5,053,482.000	
SANOFI	174,457	94.850	16,547,246.450	
STMICROELECTRONICS NV	104,058	40.295	4,193,017.110	
ELISA OYJ	20,242	42.490	860,082.580	
BANCO SANTANDER SA	2,412,875	3.849	9,287,155.870	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	14.765	968,421.580	
QIAGEN N.V.	35,613	40.780	1,452,298.140	
DEUTSCHE BANK AG-REG	282,637	12.750	3,603,621.750	
BMW VORZUG	7,821	91.450	715,230.450	
ENEL SPA	1,202,825	6.737	8,103,432.020	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	482,293	22.455	10,829,889.310	
SARTORIUS AG	3,651	315.300	1,151,160.300	
LEONARDO SPA	64,915	16.635	1,079,861.020	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	197,936	34.785	6,885,203.760	
RATIONAL AG	542	665.000	360,430.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	101.050	491,709.300	
BECHTLE AG	14,521	43.770	635,584.170	
KONINKLIJKE KPN NV	496,095	3.121	1,548,312.490	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	57.580	1,326,528.040	
TELEPERFORMANCE	7,845	128.000	1,004,160.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	28,751	186.400	5,359,186.400	
EURAZEO	5,673	70.650	400,797.450	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	70.320	908,393.760	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	76.050	1,345,324.500	
INDITEX	162,141	38.260	6,203,514.660	

ESSILORLUXOTTICA	43,937	184.400	8,101,982.800	
SNAM SPA	317,518	4.783	1,518,688.590	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	13.260	2,213,372.460	
ENAGAS	38,270	15.630	598,160.100	
TENARIS SA	76,002	14.770	1,122,549.540	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.286	259,769.790	
TERNA SPA	207,655	7.564	1,570,702.420	
BIOMERIEUX	4,870	100.150	487,730.500	
GRIFOLS SA	31,982	11.815	377,867.330	
NESTE OYJ	66,248	31.970	2,117,948.560	
RECORDATI SPA	18,197	49.100	893,472.700	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	9.278	778,795.320	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	202.400	1,759,260.800	
KONE OYJ	49,300	45.560	2,246,108.000	
ELIA GROUP	4,078	114.700	467,746.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	236.600	912,093.000	
ENGIE	277,054	16.502	4,571,945.100	
ALSTOM	47,494	11.695	555,442.330	
IPSEN SA	5,964	105.400	628,605.600	
ARKEMA SA	10,489	97.640	1,024,145.960	
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	101.900	304,782.900	
LEGRAND SA	41,105	89.540	3,680,541.700	
AMPLIFON SPA	20,249	31.400	635,818.600	
ADP	3,975	116.900	464,677.500	
ORION OYJ	13,559	41.990	569,342.410	
METSO CORPORATION	102,831	8.964	921,777.080	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	14.980	1,192,183.300	
SYMRISE AG	19,547	97.660	1,908,960.020	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	35.370	1,410,166.530	
PRYSMIAN SPA	38,343	40.410	1,549,440.630	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	90.380	219,533.020	
CAIXABANK	630,095	3.866	2,435,947.270	
BUREAU VERITAS SA	39,729	22.660	900,259.140	
GETLINK	63,968	16.230	1,038,200.640	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	17.140	680,252.320	
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	64.600	4,447,580.800	
BRENNTAG SE	21,559	82.040	1,768,700.360	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	17.525	750,700.900	
EDENRED	35,618	54.880	1,954,715.840	
TALANX AG	10,349	65.350	676,307.150	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	75.420	898,629.300	
VONOVIA SE	107,478	27.530	2,958,869.340	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	8.548	1,403,205.480	
KNORR-BREMSE AG	10,342	59.100	611,212.200	
OCI NV	12,329	25.110	309,581.190	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	52.620	2,365,900.440	

	FERRARI NV	18,850	316.900	5,973,565.000	
	ASR NEDERLAND NV	27,365	42.640	1,166,843.600	
	AIB GROUP PLC	226,914	3.950	896,310.300	
	NORDEA BANK ABP	492,403	11.488	5,656,725.660	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	32.680	565,135.240	
	MONCLER SPA	29,763	54.300	1,616,130.900	
	NEXI SPA	83,576	7.250	605,926.000	
	PROSUS NV	220,842	26.720	5,900,898.240	
	DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	77.320	1,420,445.720	
	JDE PEET'S BV	14,385	23.960	344,664.600	
	EXOR NV	14,142	89.400	1,264,294.800	
	SIEMENS ENERGY AG	74,892	12.255	917,801.460	
	EURONEXT NV	14,077	77.900	1,096,598.300	
	IMCD NV	9,332	150.900	1,408,198.800	
	WORLDLINE SA	36,232	14.235	515,762.520	
	NN GROUP NV	36,289	37.700	1,368,095.300	
	FINECOBANK SPA	96,393	13.870	1,336,970.910	
	ARGENX SE	9,078	361.300	3,279,881.400	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	125,611	25.640	3,220,666.040	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,616	32.840	2,483,229.440	
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	25.640	251,836.080	
	DSM-FIRMENICH AG	28,846	88.830	2,562,390.180	
	SYENSQO SA	11,217	93.220	1,045,648.740	
	IBERDROLA SA-RTS	899,504	0.199	179,001.290	
	ZALANDO SE	31,321	18.870	591,027.270	
	STELLANTIS NV	327,741	20.780	6,810,457.980	
	FERROVIAL SE	73,817	34.280	2,530,446.760	
	AENA SME SA	11,603	166.000	1,926,098.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	81,974	35.310	2,894,501.940	
	BANCO BPM SPA	202,727	4.877	988,699.570	
	ABN AMRO BANK NV	75,982	13.285	1,009,420.870	
	SCOUT24 SE	10,048	66.580	668,995.840	
	COVESTRO AG	27,558	50.380	1,388,372.040	
	HELLOFRESH SE	17,856	13.460	240,341.760	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	129,506	60.090	7,782,015.540	
	POSTE ITALIANE SPA	61,361	10.205	626,189.000	
	AMUNDI SA	11,288	62.750	708,322.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	11.495	481,399.100	
	ADYEN NV	3,176	1,152.000	3,658,752.000	
	DELIVERY HERO SE	22,564	23.495	530,141.180	
ユーロ　小計		27,607,825		723,364,671.260 (115,600,908,114)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	10.320	2,652,240.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	62.800	15,184,788.800	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	42.800	3,993,839.200	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	183,491	245.400	45,028,691.400	
	MTR CORP	207,441	27.500	5,704,627.500	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	85.450	10,433,103.200	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	22.500	6,704,370.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	44.550	9,481,131.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	22.450	4,534,900.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.900	9,064,795.400	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	40.550	13,661,457.200	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	19.700	13,405,751.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	10.980	1,900,264.680	
	SINO LAND CO	659,200	8.190	5,398,848.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	79.200	16,201,548.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	64.450	3,417,139.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	87.900	18,912,212.400	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	7.750	1,379,500.000	
	AIA GROUP LTD	1,729,116	62.450	107,983,294.200	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	9.220	7,349,593.920	
	SANDS CHINA LTD	335,800	22.250	7,471,550.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	12.700	1,778,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	15.340	3,092,544.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	23.600	6,044,786.000	
	ESR GROUP LTD	465,200	10.920	5,079,984.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	13.140	3,482,100.000	
	WH GROUP LTD	1,001,000	4.940	4,944,940.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	40.800	15,073,356.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	37.300	9,929,073.500	
香港・ドル　小計		11,681,369		359,288,428.900 (6,693,543,430)	
合計		169,995,753		1,209,456,597,946 (1,209,456,597,946)	

（２）株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル　小計		2,968.000	0.000 (0)	

新株予約権証券　合計			2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,252,875.960	
		GOODMAN GROUP	255,895.000	6,215,689.550	
		GPT GROUP	349,447.000	1,607,456.200	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	964,008.430	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,443,343.840	
		STOCKLAND	369,843.000	1,645,801.350	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,118,572.250	
	オーストラリア・ドル　小計		2,985,154.000	15,247,747.580 (1,489,704,938)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,558,717.380	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,784,347.760	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	777,524.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	612,305.000	
	シンガポール・ドル　小計		2,277,909.000	4,732,894.140 (518,015,264)	
投資信託受益証券　合計			5,263,063	2,007,720,202 (2,007,720,202)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,234.000	3,129,336.420	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,843,979.200	
		AMERICAN TOWER CORP	69,325.000	14,486,845.250	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,564,955.630	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,518.000	3,953,071.780	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,763,769.110	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,660,329.030	
		CROWN CASTLE INC	65,066.000	7,379,135.060	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	45,607.000	6,226,723.710	
		EQUINIX INC	13,861.000	11,149,649.790	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,913,301.900	
		EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,338,757.840	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,452,276.840	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	5,360,791.200	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,644,854.190	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,133.000	1,799,956.010	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	2,179,592.100	
		INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,956,764.270	
		IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	2,930,122.880	
		KIMCO REALTY	95,524.000	2,002,183.040	

		MID AMERICA	17,537.000	2,325,055.460	
		PROLOGIS INC	139,674.000	18,653,462.700	
		PUBLIC STORAGE	23,534.000	6,947,707.480	
		REALTY INCOME CORP	109,733.000	6,486,317.630	
		REGENCY CENTERS CORP	21,907.000	1,412,125.220	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	4,016,826.930	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	48,901.000	7,074,996.680	
		SUN COMMUNITIES INC	18,509.000	2,516,298.550	
		UDR INC	50,449.000	1,928,160.780	
		VENTAS INC	60,757.000	2,955,828.050	
		VICI PROPERTIES INC	152,711.000	4,811,923.610	
		WELLTOWER INC	77,707.000	7,050,356.110	
		WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,461,316.450	
		WP CAREY INC	32,996.000	2,201,823.080	
	アメリカ・ドル　小計		1,871,895.000	151,578,593.980 (22,077,422,214)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	837,765.880	
		SEGRO PLC	165,081.000	1,438,515.830	
	イギリス・ポンド　小計		286,426.000	2,276,281.710 (422,637,225)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	409,410.680	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	269,728.800	
	カナダ・ドル　小計		23,146.000	679,139.480 (73,951,498)	
	ユーロ	COVIVIO	5,066.000	234,657.120	
		GECINA SA	8,697.000	925,360.800	
		KLEPIERRE	36,407.000	893,063.710	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,477.000	1,222,438.320	
		WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	553,209.160	
	ユーロ　小計		88,793.000	3,828,729.110 (611,869,199)	
	香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	17,429,930.000	
	香港・ドル　小計		410,116.000	17,429,930.000 (324,719,596)	
投資証券　合計			2,680,376	23,510,599,732 (23,510,599,732)	
合計				25,518,319,934 (25,518,319,934)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率（%）	組入新株予約権証券時価比率（%）	組入投資信託受益証券時価比率（%）	組入投資証券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式	588銘柄	71.76	－	－	－	74.93
	投資証券	34銘柄	－	－	－	1.75	
イギリス・ポンド	株式	80銘柄	4.08	－	－	－	4.19
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.03	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.10	－	－	－	0.10
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄	1.95	－	－	－	2.11
	投資信託受益証券	7銘柄	－	－	0.12	－	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.31	－	－	－	3.38
	新株予約権証券	1銘柄	－	0.00	－	－	
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.30	－	－	－	0.35
	投資信託受益証券	4銘柄	－	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.80	－	－	－	2.85
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.86	－	－	－	0.88
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.97	－	－	－	0.99
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.05	－	－	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.19	－	－	－	0.19
ユーロ	株式	222銘柄	9.18	－	－	－	9.41
	投資証券	5銘柄	－	－	－	0.05	
香港・ドル	株式	29銘柄	0.53	－	－	－	0.57
	投資証券	1銘柄	－	－	－	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	3,654,200,712
コール・ローン	190,475,674
株式	79,807,323,477
投資信託受益証券	694,439,423
投資証券	60,138,506
派生商品評価勘定	31,803,710
未収配当金	135,346,691
差入委託証拠金	1,554,248,663
流動資産合計	86,127,976,856
資産合計	86,127,976,856
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	58,363,882
未払金	1,522
未払解約金	2,084,506,000
流動負債合計	2,142,871,404
負債合計	2,142,871,404
純資産の部	
元本等	
元本	54,509,988,915
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	29,475,116,537
元本等合計	83,985,105,452
純資産合計	83,985,105,452
負債純資産合計	86,127,976,856

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	70,027,488,260円
同期中追加設定元本額	39,372,022,356円
同期中一部解約元本額	54,889,521,701円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	9,894,562,328円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ専用＞	3,636,883,728円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,658,232円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	10,819,533円

ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	27,585,447円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	36,923,480円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	33,473,924円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,662,721円
たわらノーロード　新興国株式	12,687,592,462円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	1,925,520,523円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	4,569,347,145円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	33,307,369円
たわらノーロード　バランス（標準型）	143,342,253円
たわらノーロード　バランス（積極型）	261,784,782円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	93,091円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	491,029円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	101,666,257円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	120,005,558円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	206,546,002円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	11,703円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	9,803,754円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,849,911円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	9,030,615円
たわらノーロード　全世界株式	886,364,229円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	1,116,808,603円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	366,664,055円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	400,914,931円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	597,969,327円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	1,151,401,895円
投資のソムリエ	6,861,428,871円
クルーズコントロール	481,958,411円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	660,383,026円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	449,449,869円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	743,438,141円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,475,461,283円
ワールドアセットバランス（基本コース）	535,942,539円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,165,334,694円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	47,305,280円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	23,800,396円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	6,355,346円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	101,984,193円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,795,315,591円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	330,131,203円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	36,543,639円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	26,045,312円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	15,752,589円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,796,891円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	24,254,664円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	214,773,216円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	2,966,993円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	155,404,535円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	95,077,346円
計	54,509,988,915円
２．　受益権の総数	54,509,988,915口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月11日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△35,729,583

投資信託受益証券	134,830,398
投資証券	10,051,941
合計	109,152,756

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年4月19日から2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

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

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

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

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2024年1月11日現在

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

	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	27,140	16.850	457,309.000	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	35,410	11.660	412,880.600	
	VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	897,112	0.000	0.000	
	YANDEX NV	25,601	0.000	0.000	
	PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000	
	H WORLD GROUP LTD ADR	16,679	32.400	540,399.600	
	JOYY INC-ADR	3,434	32.440	111,398.960	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,056	22.910	115,832.960	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	QIFU TECHNOLOGY INC ADR	10,000	14.640	146,400.000	
	NIO INC ADR	112,414	7.410	832,987.740	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	60,221	9.040	544,397.840	
	AUTOHOME INC ADR	4,983	25.680	127,963.440	
	WEIBO CORP ADR	6,261	9.550	59,792.550	
	KANZHUN LTD ADR	19,195	14.890	285,813.550	
	KE HOLDINGS INC ADR	54,478	14.740	803,005.720	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,782	58.540	338,478.280	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	15,109	2.580	38,981.220	
	PDD HOLDINGS INC ADR	48,415	149.190	7,223,033.850	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,384	38.390	1,281,611.760	
	IQIYI INC ADR	33,439	4.410	147,465.990	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	33,649	19.130	643,705.370	
アメリカ・ドル　小計		307,332,967		16,289,473.560 (2,372,561,824)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	115,717	10.380	1,201,142.460	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	234,419	5.820	1,364,318.580	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	281,634	19.860	5,593,251.240	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	233,580	9.020	2,106,891.600	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	358,966	15.280	5,485,000.480	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	550,388	7.900	4,348,065.200	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	312,686	5.310	1,660,362.660	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	152,707	17.550	2,680,007.850	
	MULTIPLY GROUP	316,386	3.190	1,009,271.340	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	188,416	3.060	576,552.960	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	257,162	3.650	938,641.300	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		3,002,061		26,963,505.670	

				(1,071,260,080)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	246,652	2,650.100	653,652,465.200	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	59,189	451.250	26,709,036.250	
	ASIAN PAINTS LTD	31,014	3,286.850	101,938,365.900	
	BANK OF BARODA	92,818	223.850	20,777,309.300	
	EICHER MOTORS LTD	11,150	3,842.550	42,844,432.500	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	21,160	2,068.550	43,770,518.000	
	HDFC BANK LTD	227,205	1,655.950	376,240,119.750	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,684	1,632.800	123,576,835.200	
	SHREE CEMENT LTD	788	26,842.150	21,151,614.200	
	ICICI BANK LTD	416,924	993.050	414,026,378.200	
	INDUSIND BANK LTD	21,721	1,640.150	35,625,698.150	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	42,590	430.700	18,343,513.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	143,026	621.750	88,926,415.500	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	21,636	886.300	19,175,986.800	
	TATA STEEL LTD	586,692	134.100	78,675,397.200	
	TATA MOTORS LTD	135,256	808.450	109,347,713.200	
	JSW STEEL LTD	49,199	829.800	40,825,330.200	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	8,325	1,718.400	14,305,680.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	42,645	1,113.950	47,504,397.750	
	BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,047	8,031.950	16,441,401.650	
	TATA POWER CO LTD	114,167	346.450	39,553,157.150	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,830	5,086.650	44,915,119.500	
	NESTLE INDIA LTD	27,150	2,578.100	69,995,415.000	
	GAIL INDIA LTD	176,391	160.000	28,222,560.000	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	87,140	1,820.800	158,664,512.000	
	VEDANTA LTD	67,908	267.050	18,134,831.400	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	5,274	4,306.100	22,710,371.400	
	AXIS BANK LTD	184,524	1,107.000	204,268,068.000	
	TITAN COMPANY LTD	29,402	3,714.450	109,212,258.900	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,604	212.100	53,577,308.400	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,435	2,396.250	27,401,118.750	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	292,960	185.600	54,373,376.000	
	LUPIN LTD	17,129	1,405.250	24,070,527.250	
	MPHASIS LTD	6,694	2,559.400	17,132,623.600	
	BAJAJ FINANCE LTD	22,138	7,680.550	170,032,015.900	
	INFOSYS LTD	268,711	1,519.900	408,413,848.900	
	WIPRO LTD	106,724	453.600	48,410,006.400	
	TATA ELXSI LTD	3,020	8,755.450	26,441,459.000	
	MRF LTD	144	131,828.400	18,983,289.600	
	INDIAN OIL CORP LTD	225,534	130.550	29,443,463.700	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	66,630	2,577.400	171,732,162.000	

TRENT LTD	15,014	3,173.600	47,648,430.400	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,120	5,800.900	47,103,308.000	
CUMMINS INDIA LTD	12,335	2,046.150	25,239,260.250	
HCL TECHNOLOGIES LTD	77,040	1,492.100	114,951,384.000	
DABUR INDIA LTD	48,446	547.350	26,516,918.100	
HERO MOTOCORP LTD	8,789	4,138.050	36,369,321.450	
SRF LTD	11,697	2,294.900	26,843,445.300	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,071	2,649.800	18,736,735.800	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	8,653	5,787.200	50,076,641.600	
BHARTI AIRTEL LTD	181,756	1,062.700	193,152,101.200	
UNITED SPIRITS LTD	22,698	1,117.350	25,361,610.300	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	77,598	1,324.850	102,805,710.300	
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,597	3,902.650	37,453,732.050	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,018	10,010.200	110,292,383.600	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,151	1,123.000	24,875,573.000	
HAVELLS INDIA LTD	19,728	1,390.700	27,435,729.600	
TVS MOTOR COMPANY LTD	19,289	2,020.250	38,968,602.250	
INDRAPRASTHA GAS LTD	27,995	417.800	11,696,311.000	
JINDAL STEEL & POWER LTD	27,284	731.000	19,944,604.000	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	214,409	109.150	23,402,742.350	
SHRIRAM FINANCE LTD	22,842	2,150.000	49,110,300.000	
PETRONET LNG LTD	64,449	234.000	15,081,066.000	
CIPLA LTD/INDIA	42,634	1,329.200	56,669,112.800	
LARSEN & TOUBRO LTD	54,438	3,545.500	193,009,929.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,077	9,776.200	88,738,567.400	
ASHOK LEYLAND LTD	131,250	175.350	23,014,687.500	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	74,066	3,713.050	275,010,761.300	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,830	3,098.200	42,848,106.000	
NTPC LTD	347,936	313.350	109,025,745.600	
YES BANK LTD	977,054	25.500	24,914,877.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	52,658	526.150	27,706,006.700	
BHARAT FORGE LTD	20,684	1,283.850	26,555,153.400	
SUZLON ENERGY LTD	722,047	43.550	31,445,146.850	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,664	580.050	57,810,103.200	
ITC LTD	243,576	463.300	112,848,760.800	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,991	2,709.300	32,487,216.300	
UNITED PHOSPHORUS LTD	40,105	558.600	22,402,653.000	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,201	2,352.900	19,296,132.900	
SIEMENS INDIA LTD	7,072	4,180.750	29,566,264.000	
INFO EDGE INDIA LTD	5,742	5,243.400	30,107,602.800	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	50,735	468.450	23,766,810.750	

GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,516	1,141.300	37,110,510.800	
TECH MAHINDRA LTD	43,452	1,240.900	53,919,586.800	
INDIAN HOTELS CO LTD	67,997	458.400	31,169,824.800	
MARICO LTD	39,330	531.300	20,896,029.000	
POWER FINANCE CORP LTD	119,321	390.500	46,594,850.500	
PAGE INDUSTRIES LTD	508	37,138.800	18,866,510.400	
ABB LTD/INDIA	4,777	4,935.700	23,577,838.900	
DLF LTD	49,742	796.050	39,597,119.100	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	369,258	239.150	88,308,050.700	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	3,889	7,381.300	28,705,875.700	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,610	1,214.350	51,743,453.500	
REC LTD	107,141	420.800	45,084,932.800	
BAJAJ FINSERV LTD	30,672	1,671.850	51,278,983.200	
BAJAJ AUTO LTD	5,519	7,053.750	38,929,646.250	
JUBILANT FOODWORKS LTD	30,266	522.900	15,826,091.400	
ADANI POWER LTD	62,307	542.300	33,789,086.100	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,379	1,475.350	16,788,007.650	
COAL INDIA LTD	124,565	382.050	47,590,058.250	
TATA MOTORS LTD	33,523	539.050	18,070,573.150	
PI INDUSTRIES LTD	7,267	3,459.400	25,139,459.800	
VARUN BEVERAGES LTD	36,637	1,268.700	46,481,361.900	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	8,498	3,911.900	33,243,326.200	
LTIMINDTREE LTD	7,277	5,947.500	43,279,957.500	
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,366	1,723.250	43,711,959.500	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	78,537	644.950	50,652,438.150	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	772.450	12,203,937.550	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	15,727	3,017.300	47,453,077.100	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,689	3,418.900	26,287,922.100	
BANDHAN BANK LTD	52,105	231.050	12,038,860.250	
GODREJ PROPERTIES LTD	9,790	2,210.900	21,644,711.000	
POLYCAB INDIA LTD	3,386	4,911.850	16,631,524.100	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	33,265	1,216.250	40,458,556.250	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	22,115	765.450	16,927,926.750	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	18,362	941.700	17,291,495.400	
ZOMATO LTD	419,610	134.650	56,500,486.500	
MACROTECH DEVELOPERS LTD	21,458	1,136.950	24,396,673.100	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	62,992	734.200	46,248,726.400	

	APL APOLLO TUBES LTD	12,592	1,565.950	19,718,442.400	
	SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	32,684	614.700	20,090,854.800	
	ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	17,909	685.150	12,270,351.350	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	264,027	240.950	63,617,305.650	
	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	10,849	1,810.950	19,646,996.550	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	22,656	592.650	13,427,078.400	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	13,233	3,822.000	50,576,526.000	
	IDFC BANK LTD	285,952	83.900	23,991,372.800	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	18,897	1,388.050	26,229,980.850	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,024	541.250	17,874,240.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	10,946	3,082.150	33,737,213.900	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	35,977	1,451.450	52,218,816.650	
インド・ルピー　小計		10,824,367		7,981,674,256.550 (14,127,563,434)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	547,000	1,655.000	905,285,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,178,385	1,115.000	2,428,899,275.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	112,201	23,300.000	2,614,283,300.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	364,000	6,350.000	2,311,400,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	591,600	3,410.000	2,017,356,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,604,200	5,525.000	8,863,205,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,988,600	4,000.000	15,954,400,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	637,600	4,770.000	3,041,352,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	192,100	8,000.000	1,536,800,000.000	
	BANK MANDIRI	3,038,000	6,425.000	19,519,150,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,597,200	5,700.000	31,904,040,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,192,000	5,600.000	6,675,200,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,785,000	1,580.000	2,820,300,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	234,932	6,325.000	1,485,944,900.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,499,300	9,550.000	42,968,315,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,250,300	2,460.000	3,075,738,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	194,100	11,350.000	2,203,035,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,482,800	2,750.000	4,077,700,000.000	

	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,523,700	955.000	1,455,133,500.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	66,987,200	87.000	5,827,886,400.000	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL PT	528,400	6,900.000	3,645,960,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	794,082	2,470.000	1,961,382,540.000	
インドネシア・ルピア　小計		99,322,700		167,292,765,915.000 (1,572,552,000)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	39.230	511,245.360	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	52.810	306,298.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	9.780	222,006.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	20.430	121,354.200	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	50.550	151,650.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	15,000	13.000	195,000.000	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	7,140	14.130	100,888.200	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	7.670	92,040.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	5,180	42.870	222,066.600	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	12,200	11.520	140,544.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	13.760	240,800.000	
	UNISPLENDOUR CORP LTD	7,040	17.040	119,961.600	
	JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	12.920	135,660.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	12.550	239,705.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	49.710	59,652.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	13.480	218,376.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	2,200	26.700	58,740.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	137.950	289,695.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	25.920	305,856.000	
	NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	12.880	114,632.000	

MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	22.490	182,169.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	13,600	14.130	192,168.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	15.750	218,925.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	14.460	345,594.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	6.180	194,670.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	3.400	210,120.000	
GEM CO LTD	29,100	5.180	150,738.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	66.600	173,160.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	21.660	149,454.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	58,100	4.770	277,137.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	14.780	249,782.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	5,900	85.440	504,096.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	6.720	104,784.960	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	21.220	125,282.880	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,812	17.200	99,966.400	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	6.970	206,312.000	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	22.160	296,057.600	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	16.010	105,666.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	25.800	131,580.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	41.130	382,509.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	20.130	209,352.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	1,000	34.140	34,140.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	24,000	36.730	881,520.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	14,350	52.320	750,792.000	
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	5,700	19.270	109,839.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	10.640	191,520.000	

CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	11.560	208,080.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	55.440	559,944.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	9.000	100,800.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	24,800	8.450	209,560.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.580	96,758.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	7.920	44,352.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	16.190	228,279.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	27.110	325,320.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	20.500	159,900.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	10.040	517,562.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	49.810	298,860.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,239	59.210	132,571.190	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	11,470	29.660	340,200.200	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.650	135,255.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	3.750	137,625.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	39,729	14.940	593,551.260	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	26.430	285,444.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	3,584	22.960	82,288.640	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	500	30.610	15,305.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	14.880	102,672.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	83,200	5.480	455,936.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	49.600	243,040.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	11.730	179,469.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	6,200	35.500	220,100.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	28.330	141,650.000	

37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	17.750	282,225.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	17.980	176,204.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,700	160.510	1,235,927.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	4,800	57.270	274,896.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	5.510	82,374.500	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	14.820	202,663.500	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	8,740	9.890	86,438.600	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	9,682	8.790	85,104.780	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	33.180	301,938.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,600	141.490	509,364.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.140	223,987.200	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	7.920	113,256.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	31,154	31.220	972,627.880	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	15.150	452,985.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.140	141,350.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.110	435,643.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	8.710	173,329.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	16.390	313,049.000	
IFLYTEK CO LTD	14,700	39.400	579,180.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.120	198,008.000	
GOERTEK INC	25,100	18.690	469,119.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.520	138,876.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	19.440	684,288.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	34,900	11.940	416,706.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	129,320	4.220	545,730.400	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.090	144,047.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	2.960	111,296.000	

CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	14.410	583,432.080	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.060	137,562.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,300	26.880	330,624.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	48.050	505,486.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	77,918	12.980	1,011,375.640	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,800	100.250	781,950.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	18,700	128.800	2,408,560.000	
WANDA FILM HOLDING CO LTD	21,700	12.470	270,599.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	6,700	7.390	49,513.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.720	811,332.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	8.640	396,576.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	33.670	407,407.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	8.160	345,168.000	
PING AN BANK CO LTD	97,200	9.090	883,548.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	24,480	19.320	472,953.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	133,800	4.230	565,974.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	9.740	536,674.000	
ZTE CORP	16,500	23.800	392,700.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.590	187,815.000	
WEICHAI POWER CO LTD	20,000	14.030	280,600.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	35.050	147,210.000	
GF SECURITIES CO LTD	15,300	13.820	211,446.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	7.590	160,149.000	
BYD CO LTD	8,400	190.290	1,598,436.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	5.430	163,986.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	5.680	193,688.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	22.930	221,503.800	

SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	47.400	247,428.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	16.480	181,280.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	9.400	402,320.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	33.800	70,980.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	23.890	229,344.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	15.030	175,851.000	
RISEN ENERGY CO LTD	1,100	16.900	18,590.000	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU CO LTD	15,200	10.270	156,104.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	14.360	114,880.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	14.040	178,308.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,200	226.800	498,960.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	5.670	170,667.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	20.650	264,320.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.620	226,404.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	67,400	5.440	366,656.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	10.970	60,883.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	211.210	359,057.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	6.690	104,364.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	39.840	262,944.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	53.900	32,340.000	
NINESTAR CORP	1,100	19.660	21,626.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	5.260	200,932.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	6.880	174,889.600	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	47.720	76,352.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	17.180	290,342.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	26.440	282,908.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	104.840	190,808.800	

JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	69.730	125,514.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	5.450	82,295.000	
SF HOLDING CO LTD	24,400	39.040	952,576.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.480	129,328.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	36.750	147,000.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	57.060	142,650.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	36,190	6.110	221,120.900	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	7.850	305,365.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	4.690	342,370.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	38.800	89,240.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	21.560	562,716.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	19.360	125,084.960	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	13.750	125,125.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	24,800	13.020	322,896.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	55.750	172,825.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	9.860	221,850.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46	24.920	1,146.320	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	6.310	244,828.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	21.890	80,993.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	14.430	220,461.540	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	2,200	76.650	168,630.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	26.960	118,893.600	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,700	51.200	189,440.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	40.210	108,567.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	24.310	75,361.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	65.050	136,605.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	30.250	275,759.000	

HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	11.760	111,720.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,100	100.000	310,000.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	100	47.050	4,705.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	26.410	182,229.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	64.310	291,967.400	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	116.480	349,440.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	43.890	57,057.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	4,800	25.480	122,304.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	25.770	79,887.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	25.250	80,800.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.270	92,329.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	49.760	119,424.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	11.590	246,867.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	9.410	124,212.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	100	59.990	5,999.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	54.070	102,733.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	36,700	7.630	280,021.000	
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	11,800	21.380	252,284.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	57,600	12.910	743,616.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,800	277.570	1,609,906.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	60,800	3.840	233,472.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.360	114,080.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,600	63.500	101,600.000	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	4,050	48.110	194,845.500	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	13.810	117,385.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	20.530	83,351.800	
SG MICRO CORP	3,395	73.380	249,125.100	

CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	20,240	150.660	3,049,358.400	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	76.580	230,965.280	
WUXI APPTEC CO LTD	13,972	67.620	944,786.640	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	51,400	5.560	285,784.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	26.960	277,688.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	84,000	4.210	353,640.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	3.530	291,225.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	38.250	279,225.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	119.730	306,508.800	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	25,300	14.570	368,621.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	26.100	193,792.500	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	960	53.580	51,436.800	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	242.900	267,190.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	53.210	58,531.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,655	22.920	129,612.600	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	45.090	113,626.800	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	136.940	410,820.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	54.940	296,676.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	53,400	4.290	229,086.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	36.100	97,470.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	29.250	239,850.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	5,030	93.570	470,657.100	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	3,325	31.160	103,607.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	11.670	149,376.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.550	291,465.000	

PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	3.160	223,412.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	19.530	208,971.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	7.490	185,752.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	70.300	154,660.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	37.310	108,199.000	
CGN POWER CO LTD	13,200	3.360	44,352.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	199,300	4.740	944,682.000	
GONEO GROUP CO LTD	1,900	91.270	173,413.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	56.090	179,488.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	164.120	131,296.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,536	122.800	188,620.800	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	4,600	34.820	160,172.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	117,600	4.380	515,088.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	9.730	204,330.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	42.330	135,456.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	38.820	89,286.000	
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	900	84.450	76,005.000	
HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	596	282.700	168,489.200	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	4,000	44.300	177,200.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	5.820	253,170.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	5,070	24.040	121,882.800	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	76.530	107,142.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	31.590	192,699.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	21.480	34,368.000	
SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD	7,600	16.200	123,120.000	

HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	34.230	205,380.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,860	53.810	153,896.600	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	19.790	229,009.880	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.610	235,316.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	7,077	76.800	543,513.600	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	72.990	211,671.000	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	5,320	16.880	89,801.600	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	95.850	249,210.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,900	33.900	267,810.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	34.000	156,400.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	2,600	136.850	355,810.000	
PIOTECH INC	592	197.730	117,056.160	
ASR MICROELECTRONICS CO LTD	4,000	58.670	234,680.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	8.490	341,298.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	2,800	118.450	331,660.000	
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP INC	5,600	34.730	194,488.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,060	37.000	150,220.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,100	315.410	346,951.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	128.940	412,608.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	251.100	614,441.700	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	16.120	306,280.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	840	272.070	228,538.800	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	29.070	250,002.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.050	380,480.000	

ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	16,800	14.200	238,560.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	7.410	869,193.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	305,700	4.850	1,482,645.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	413,100	3.710	1,532,601.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	4.040	791,840.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	173,000	5.500	951,500.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	25.800	356,040.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,900	33.850	1,147,515.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	98,300	28.050	2,757,315.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	52,800	37.820	1,996,896.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	106,900	14.610	1,561,809.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	159,500	6.570	1,047,915.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	133,400	3.760	501,584.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	13.220	561,850.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	6,000	1,641.500	9,849,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	194,300	5.840	1,134,712.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	59,700	19.460	1,161,762.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	38,700	22.730	879,651.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.200	199,160.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	120,200	23.340	2,805,468.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	7.370	608,762.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	2.950	679,385.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	228,800	4.750	1,086,800.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	8.930	495,615.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.870	415,009.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	29,600	26.570	786,472.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	66,400	4.670	310,088.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	124,800	3.990	497,952.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	133,600	6.040	806,944.000	

ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	22.410	519,912.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	13.130	542,269.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	8.580	506,220.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	23.130	270,621.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	55,700	9.070	505,199.000	
CRRC CORP LTD	141,700	5.200	736,840.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	33,352	41.500	1,384,108.000	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	17,400	18.320	318,768.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	13.510	544,453.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	85,600	5.670	485,352.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,600	29.280	193,248.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	25,700	21.490	552,293.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	13.230	637,686.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.280	433,564.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	6.580	369,796.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	24.190	299,956.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	7.760	204,864.000	
GEMDALE CORP	39,700	4.170	165,549.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	33,300	13.070	435,231.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	16,000	73.000	1,168,000.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.140	325,818.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	103,500	12.280	1,270,980.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	7.450	410,495.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	13.360	510,352.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	41,712	21.630	902,230.560	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	6.000	178,800.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	81.700	800,660.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	8.370	258,633.000	

INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.420	315,950.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	69.700	306,680.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	2.980	74,500.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	37,200	5.510	204,972.000	
AIR CHINA LTD	44,800	7.030	314,944.000	
TBEA CO LTD	24,180	14.120	341,421.600	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	6.150	267,525.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	3.020	169,724.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	4.720	491,824.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	21,200	29.160	618,192.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	31.450	327,080.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	28.540	196,926.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	18.140	270,286.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.790	129,997.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	5,800	16.180	93,844.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	25,200	8.520	214,704.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	8.000	264,000.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	14.890	352,893.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	16.450	187,530.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	33.950	315,735.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	7.530	431,469.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	15,853	7.230	114,617.190	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	48,070	9.350	449,454.500	
CMOC GROUP LIMITED	53,400	5.290	282,486.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	37,900	9.510	360,429.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	33,800	5.530	186,914.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	51.360	462,240.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	22.570	454,108.400	

ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	20.880	162,864.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	9.580	265,366.000	
PEOPLE.CN CO LTD	7,000	24.530	171,710.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	84,500	2.760	233,220.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.350	362,205.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	21,000	21.670	455,070.000	
YUTONG BUS CO LTD	23,900	15.450	369,255.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	6.740	289,146.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	3.720	295,740.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	14.260	214,170.940	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.630	326,540.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	23.100	177,870.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	24.690	253,418.160	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	15.030	244,237.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	16.820	55,506.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	5.710	257,521.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.310	136,290.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	38.880	396,576.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.920	187,488.000	
YOUNGOR FASHION CO LTD	25,600	6.580	168,448.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	36.800	169,280.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.910	116,088.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	800	23.520	18,816.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	14,200	7.200	102,240.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	22,350	10.160	227,076.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	3.690	145,386.000	
HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD	300	20.740	6,222.000	

FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	5.000	98,000.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	14.620	340,646.000	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,500	219.020	547,550.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	6.640	226,424.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	6,380	213.100	1,359,578.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	11.230	141,498.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.260	355,568.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	6.190	154,750.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	1,250	28.720	35,900.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	15.990	324,597.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	29,200	2.960	86,432.000	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	2,700	29.690	80,163.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	8.360	266,684.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	11.250	141,750.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	12.330	321,813.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	26.500	111,300.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.420	245,944.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	7.500	355,950.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	15.960	202,692.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	13.620	79,404.600	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	19,500	9.200	179,400.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	11.990	141,482.000	
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	22,400	9.940	222,656.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	20,900	16.500	344,850.000	
TONGWEI CO LTD	17,000	24.860	422,620.000	

SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	10,654	45.160	481,134.640	
JCET GROUP CO LTD	10,900	25.610	279,149.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	20.740	141,032.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	62.760	156,900.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	29.940	158,682.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	26.760	280,712.400	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	89.700	152,490.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	9.330	188,895.180	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	2.330	145,392.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	12.520	165,264.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,924	56.200	220,528.800	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	6.570	128,772.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	10.950	214,620.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	11.630	229,111.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	14.760	231,732.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	2,210	59.900	132,379.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	34.570	169,393.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	17.830	99,848.000	
SHEDE SPIRITS CO LTD	2,100	91.310	191,751.000	
BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	15.200	224,960.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	33.550	140,910.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,500	46.320	69,480.000	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	68.480	61,632.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	1,540	87.780	135,181.200	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	24.910	64,766.000	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	1,000	174.710	174,710.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,600	66.760	106,816.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	133.260	186,564.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	40.600	288,260.000	

TRINA SOLAR CO LTD	11,100	27.690	307,359.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.290	651,222.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	26.910	312,156.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	67,300	6.060	407,838.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	103.000	103,000.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	840	284.990	239,391.600	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	2,320	81.860	189,915.200	
3PEAK INC	1,200	121.470	145,764.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	160	39.210	6,273.600	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,800	67.990	530,322.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	43,468	22.230	966,293.640	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	17.720	225,044.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	120.390	216,702.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.060	370,898.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	32.560	332,112.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	40,151	22.400	899,382.400	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	27,119	34.820	944,283.580	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	4,400	45.530	200,332.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	25.330	177,310.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	7.790	102,828.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	63.180	442,260.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	1,000	12.020	12,020.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	14.410	586,487.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	7.980	837,900.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	42.700	145,180.000	
SERES GROUP CO LTD	9,000	68.500	616,500.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	60.450	320,385.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,800	42.970	120,316.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	6.840	569,088.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	12,200	10.010	122,122.000	

	SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	18.800	214,320.000	
	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,400	55.900	78,260.000	
	SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	16.390	32,780.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	4,100	11.930	48,913.000	
	JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	950	35.200	33,440.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	11.270	342,608.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	6.470	273,681.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	70.660	226,112.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	17.260	317,584.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,012	24.540	98,454.480	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	4,004	40.420	161,841.680	
	G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	500	219.500	109,750.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	51.200	150,528.000	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	16.590	187,632.900	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	8.180	403,274.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	51.850	342,210.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	14.450	231,200.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	33.860	152,370.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	103,500	2.230	230,805.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	10.750	115,025.000	
オフショア・人民元　小計		13,954,547		171,167,548.900 (3,470,713,039)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	374,259	16.350	6,119,134.650	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	257,559	5.706	1,469,631.650	
	OOREDOO QSC	60,920	10.560	643,315.200	
	QATAR FUEL QSC	46,222	16.000	739,552.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,416	17.640	660,018.240	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	69,658	10.680	743,947.440	
	INDUSTRIES QATAR QSC	122,724	12.470	1,530,368.280	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	132,031	20.180	2,664,385.580	

	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	190,107	3.610	686,286.270	
	MASRAF AL RAYAN	463,723	2.510	1,163,944.730	
	BARWA REAL ESTATE CO	209,228	2.866	599,647.440	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	382,470	1.795	686,533.650	
	DUKHAN BANK	131,518	3.963	521,205.830	
カタール・リアル　小計		2,477,835		18,227,970.960 (729,483,398)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	665,826	0.764	508,691.060	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	152,316	0.518	78,899.680	
	GULF BANK KSCP	146,991	0.282	41,451.460	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	606,206	0.943	571,652.250	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	125,143	0.537	67,201.790	
	MABANEE CO KPSC	61,792	0.818	50,545.850	
	BOUBYAN BANK KSCP	107,429	0.627	67,357.980	
クウェート・ディナール　小計		1,865,703		1,385,800.070 (657,672,997)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	39,057	17,400.000	679,591,800.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,049	34,500.000	691,690,500.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	37,131	32,060.000	1,190,419,860.000	
コロンビア・ペソ　小計		96,237		2,561,702,160.000 (94,762,486)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	21,587	38.950	840,813.650	
	JARIR MARKETING CO	45,430	15.620	709,616.600	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	5,690	135.400	770,426.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	30,535	51.700	1,578,659.500	
	SAUDI BRITISH BANK	81,756	36.700	3,000,445.200	
	AL RAJHI BANK	158,494	86.800	13,757,279.200	
	ARAB NATIONAL BANK	54,333	24.920	1,353,978.360	
	BANK ALBILAD	39,341	45.700	1,797,883.700	
	BANK AL-JAZIRA	29,917	18.960	567,226.320	
	BANQUE SAUDI FRANSI	47,778	40.800	1,949,342.400	
	RIYAD BANK	118,733	28.750	3,413,573.750	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,345	16.180	668,962.100	
	SAUDI TELECOM CO	162,535	41.100	6,680,188.500	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	18,341	133.600	2,450,357.600	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	73,081	80.000	5,846,480.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	67,449	19.400	1,308,510.600	

	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	27,847	21.700	604,279.900	
	SAVOLA GROUP	20,951	43.700	915,558.700	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	23,986	12.120	290,710.320	
	ALMARAI CO JSC	19,978	62.700	1,252,620.600	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,024	198.200	599,356.800	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	31,604	32.850	1,038,191.400	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,164	38.800	394,363.200	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,476	10.700	647,093.200	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	46,657	14.200	662,529.400	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	29,849	10.060	300,280.940	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	36,059	14.020	505,547.180	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,510	219.000	1,425,690.000	
	ALINMA BANK	79,834	41.350	3,301,135.900	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	104,013	46.950	4,883,410.350	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,975	118.200	942,645.000	
	DALLAH HEALTHCARE CO	2,553	173.200	442,179.600	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	215,578	32.900	7,092,516.200	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	7,189	292.400	2,102,063.600	
	ACWA POWER CO	7,732	238.000	1,840,216.000	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	3,981	151.600	603,519.600	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,248	347.800	781,854.400	
	NAHDI MEDICAL CO	3,277	139.800	458,124.600	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,500	207.200	725,200.000	
	ELM CO	1,951	887.200	1,730,927.200	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	6,635	62.900	417,341.500	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	239,164	42.900	10,260,135.600	
サウジアラビア・リアル　小計		1,999,080		90,911,234.670 (3,536,447,029)	
タイ・バーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	94,700	26.250	2,485,875.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	303,000	18.300	5,544,900.000	
	CP AXTRA PCL NVDR	159,300	28.000	4,460,400.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	45,400	129.500	5,879,300.000	

TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,317,300	1.620	3,754,026.000	
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	650,500	6.600	4,293,300.000	
SHIN CORP PCL	70,700	72.000	5,090,400.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	19.100	5,730,000.000	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	93,000	216.000	20,088,000.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	548,420	11.900	6,526,198.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	252,700	85.000	21,479,500.000	
PTT PCL	795,100	35.250	28,027,275.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	80,500	44.500	3,582,250.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	656,100	7.950	5,215,995.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	63,750	293.000	18,678,750.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	357,600	63.000	22,528,800.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	177,700	66.000	11,728,200.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	880,200	27.750	24,425,550.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	48,200	235.000	11,327,000.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	296,710	27.750	8,233,702.500	
THAI OIL PCL NVDR	89,000	53.250	4,739,250.000	
CP ALL PCL NVDR	455,000	54.250	24,683,750.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	643,100	7.300	4,694,630.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	113,645	148.000	16,819,460.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	135,122	26.250	3,546,952.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	183,408	36.750	6,740,244.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	142,900	43.500	6,216,150.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	629,900	8.100	5,102,190.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	238,100	45.000	10,714,500.000	
OSOTSPA PCL NVDR	90,600	21.500	1,947,900.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	527,100	4.120	2,171,652.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	157,833	39.250	6,194,945.250	
SCG PACKAGING PCL NVDR	97,800	34.750	3,398,550.000	
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	277,100	19.300	5,348,030.000	
SCB X PCL NVDR	67,700	104.000	7,040,800.000	
TRUE CORP PCL NVDR	896,328	5.150	4,616,089.200	

	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	58,700	46.500	2,729,550.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	76,900	49.000	3,768,100.000	
タイ・バーツ　小計		13,071,116		339,552,164.450 (1,412,537,004)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,881	746.500	4,390,166.500	
	CEZ	12,777	976.500	12,476,740.500	
	MONETA MONEY BANK AS	33,423	95.100	3,178,527.300	
チェコ・コルナ　小計		52,081		20,045,434.300 (130,393,546)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,279,808	43.000	227,031,744.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	6,880	23,700.000	163,056,000.000	
	BANCO DE CHILE	3,730,618	99.380	370,748,816.840	
	EMPRESAS CMPC SA	84,902	1,704.800	144,740,929.600	
	EMPRESAS COPEC SA	29,969	6,200.000	185,807,800.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,173,923	59.710	70,094,942.330	
	ENEL AMERICAS SA	1,683,461	99.000	166,662,639.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,823,587	9.775	135,125,562.920	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	11,218	47,290.000	530,499,220.000	
	FALABELLA SA	78,482	2,200.000	172,660,400.000	
	CENCOSUD SA	115,184	1,639.000	188,786,576.000	
	ENEL CHILE SA	2,550,215	54.000	137,711,610.000	
チリ・ペソ　小計		28,568,247		2,492,926,240.690 (395,507,734)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	260,385	40.740	10,608,084.900	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	117,614	47.480	5,584,312.720	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	107,671	45.040	4,849,501.840	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,691	768.000	4,370,688.000	
	HEKTAS TICARET TAS	78,592	18.430	1,448,450.560	
	KOC HOLDING AS	60,321	147.100	8,873,219.100	
	SASA POLYESTER SANAYI	105,230	35.780	3,765,129.400	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	109,000	48.460	5,282,140.000	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	9,553	221.200	2,113,123.600	
	TURK HAVA YOLLARI	44,287	249.900	11,067,321.300	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	104,797	61.500	6,445,015.500	
	TURKIYE IS BANKASI	262,880	25.700	6,756,016.000	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	81,358	139.700	11,365,712.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	281,190	23.560	6,624,836.400	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	82,771	66.000	5,462,886.000	

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	37,811	318.250	12,033,350.750	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	78,429	19.600	1,537,208.400	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	3,431	711.000	2,439,441.000	
トルコ・リラ　小計		1,831,011		110,626,438.070 (539,137,946)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	11,459	9,095.000	104,219,605.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	36,818	2,814.000	103,605,852.000	
	OTP BANK NYRT	19,154	16,700.000	319,871,800.000	
ハンガリー・フォリント　小計		67,431		527,697,257.000 (223,165,808)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	594,900	34.450	20,494,305.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	161,790	48.300	7,814,457.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	156,808	104.800	16,433,478.400	
	AYALA CORP	18,653	665.000	12,404,245.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	79,760	241.000	19,222,160.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	229,760	40.900	9,397,184.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	34,240	250.000	8,560,000.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	116,455	55.500	6,463,252.500	
	BDO UNIBANK INC	189,402	135.100	25,588,210.200	
	PLDT INC	5,690	1,288.000	7,328,720.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	820,375	33.150	27,195,431.250	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	75,450	119.800	9,038,910.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,383	884.000	17,134,572.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,420	382.000	9,328,440.000	
フィリピン・ペソ　小計		2,527,086		196,403,365.350 (508,272,269)	
ブラジル・レアル	VALE SA	275,689	72.230	19,913,016.470	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	62,900	10.190	640,951.000	
	RAIA DROGASIL SA	104,664	28.690	3,002,810.160	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,450	47.530	971,988.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	98,300	42.760	4,203,308.000	
	BANCO DO BRASIL SA	70,700	54.430	3,848,201.000	
	ITAUSA SA	437,907	10.150	4,444,756.050	
	GERDAU SA	93,181	21.480	2,001,527.880	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	298,710	39.030	11,658,651.300	
	VIBRA ENERGIA SA	98,600	22.680	2,236,248.000	

	PETROLEO BRASILEIRO SA	389,112	37.750	14,688,978.000	
	CCR SA	79,920	13.820	1,104,494.400	
	WEG SA	135,644	35.320	4,790,946.080	
	BANCO BRADESCO SA PREF	438,202	16.020	7,019,996.040	
	BANCO BRADESCO SA	126,592	14.450	1,829,254.400	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	48,206	17.910	863,369.460	
	SUZANO SA	62,875	53.770	3,380,788.750	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	38.540	651,326.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	395,847	33.290	13,177,746.630	
	ENGIE BRASIL SA	15,287	44.320	677,519.840	
	LOCALIZA RENT A CAR	74,689	63.000	4,705,407.000	
	LOJAS RENNER SA	82,820	16.490	1,365,701.800	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	61,204	27.100	1,658,628.400	
	COSAN SA	98,200	19.220	1,887,404.000	
	TOTVS SA	44,400	32.440	1,440,336.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	81,000	35.430	2,869,830.000	
	JBS SA	62,900	24.280	1,527,212.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	109,262	12.010	1,312,236.620	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,198	74.760	2,033,322.480	
	ENEVA SA	68,200	12.980	885,236.000	
	HYPERA SA	29,800	35.040	1,044,192.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	462,648	13.920	6,440,060.160	
	MAGAZINE LUIZA SA	239,400	2.180	521,892.000	
	PRIO SA	63,800	44.350	2,829,530.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	33,228	50.620	1,682,001.360	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,100	33.190	1,928,339.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	412,761	4.450	1,836,786.450	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	54,800	11.470	628,556.000	
	AMBEV SA	382,795	13.760	5,267,259.200	
	NATURA &CO HOLDING SA	68,800	16.760	1,153,088.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	109,000	13.580	1,480,220.000	
	TIM SA	70,700	17.290	1,222,403.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	46,300	28.430	1,316,309.000	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	267	18.310	4,888.770	
	RUMO SA	105,100	23.810	2,502,431.000	
ブラジル・レアル　小計		6,117,058		150,649,148.200 (4,480,471,382)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	531.200	713,932.800	

	BUDIMEX SA	1,092	630.000	687,960.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,918	112.450	1,227,729.100	
	BANK PEKAO SA	14,797	147.500	2,182,557.500	
	ORLEN SA	46,737	62.560	2,923,866.720	
	LPP SA	92	15,860.000	1,459,120.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,835	478.200	1,355,697.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,671	111.200	519,415.200	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	69,851	49.520	3,459,021.520	
	CYFROWY POLSAT SA	21,710	11.800	256,178.000	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	79,636	8.698	692,673.920	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	48,154	46.250	2,227,122.500	
	DINO POLSKA SA	3,987	459.900	1,833,621.300	
	ALLEGRO.EU SA	41,696	31.450	1,311,339.200	
	PEPCO GROUP NV	16,587	24.200	401,405.400	
ポーランド・ズロチ　小計		364,107		21,251,640.160 (783,836,995)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	168,600	4.150	699,690.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	522,200	5.950	3,107,090.000	
	CELCOMDIGI BHD	272,700	4.230	1,153,521.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	88,120	7.680	676,761.600	
	RHB BANK BHD	103,780	5.520	572,865.600	
	GAMUDA BHD	156,100	4.900	764,890.000	
	GENTING BHD	164,900	4.870	803,063.000	
	HONG LEONG BANK BHD	49,008	18.900	926,251.200	
	IOI CORP BHD	223,013	3.960	883,131.480	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,500	22.280	969,180.000	
	MALAYAN BANKING BHD	444,275	9.000	3,998,475.000	
	MISC BHD	102,180	7.300	745,914.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,200	120.000	744,000.000	
	PPB GROUP BHD	55,660	14.600	812,636.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,900	21.100	483,190.000	
	PETRONAS GAS BHD	61,000	17.520	1,068,720.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	240,100	2.850	684,285.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,300	5.700	543,210.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	213,550	10.480	2,238,004.000	
	QL RESOURCES BHD	102,850	5.880	604,758.000	
	DIALOG GROUP BHD	292,144	2.070	604,738.080	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,147,850	4.310	4,947,233.500	
	SIME DARBY BERHAD	234,400	2.430	569,592.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	239,500	2.520	603,540.000	
	MAXIS BHD	175,800	3.860	678,588.000	
	INARI AMERTRON BHD	221,900	3.210	712,299.000	

	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	217,400	7.000	1,521,800.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	192,300	6.060	1,165,338.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	284,100	4.900	1,392,090.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	161,500	4.350	702,525.000	
	MR DIY GROUP M BHD	245,100	1.460	357,846.000	
マレーシア・リンギット　小計		6,547,930		35,735,225.460 (1,121,332,066)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	262,900	13.260	3,486,054.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	107,100	83.910	8,986,761.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,360	308.550	5,047,878.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	15,860	175.970	2,790,884.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	44,800	176.170	7,892,416.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	211,800	165.420	35,035,956.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	87,025	35.070	3,051,966.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,495	228.280	3,537,198.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	121,600	37.380	4,545,408.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	15,465	478.690	7,402,940.850	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	254,352	86.470	21,993,817.440	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	158,000	44.540	7,037,320.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,800	178.390	7,635,092.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	429,800	69.590	29,909,782.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	32,490	275.170	8,940,273.300	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	22,800	161.420	3,680,376.000	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	104,000	22.660	2,356,640.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,549,478	15.290	23,691,518.620	
	BANCO DEL BAJIO SA	69,500	58.240	4,047,680.000	
メキシコ・ペソ　小計		3,561,625		191,069,962.760 (1,639,131,890)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	54,745	3.448	188,760.760	
	ALPHA BANK A.E.	185,624	1.591	295,327.780	
	NATIONAL BANK OF GREECE	65,590	6.772	444,175.480	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,083	13.220	212,617.260	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	

	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	201,792	1.699	342,844.600	
	MYTILINEOS HOLDINGS	7,737	37.860	292,922.820	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,506	24.700	135,998.200	
	OPAP SA	16,204	15.850	256,833.400	
	JUMBO SA	9,500	25.140	238,830.000	
	PUBLIC POWER CORP	16,875	12.300	207,562.500	
ユーロ　小計		582,786		2,615,872.800 (418,042,632)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,720	84,800.000	145,856,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,928	110,100.000	322,372,800.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,478	245,500.000	608,349,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,655	77,500.000	283,262,500.000	
	COWAY CO LTD	4,084	54,700.000	223,394,800.000	
	KT&G CORP	7,940	90,900.000	721,746,000.000	
	KAKAO CORP	25,233	59,200.000	1,493,793,600.000	
	KUM YANG CO LTD	2,599	101,800.000	264,578,200.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	4,022	23,500.000	94,517,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	3,745	49,000.000	183,505,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	23,496	7,060.000	165,881,760.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,142	221,500.000	252,953,000.000	
	LG UPLUS CORP	17,131	10,070.000	172,509,170.000	
	DOOSAN ENERBILITY	36,105	15,190.000	548,434,950.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	4,225	54,000.000	228,150,000.000	
	LG H&H CO LTD	762	332,500.000	253,365,000.000	
	LG CHEM LTD	4,014	464,500.000	1,864,503,000.000	
	LG CHEM LTD	599	296,000.000	177,304,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	35,462	36,750.000	1,303,228,500.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	19,891	19,080.000	379,520,280.000	
	S-OIL CORP	3,289	67,000.000	220,363,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	9,175	38,550.000	353,696,250.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,664	36,850.000	208,718,400.000	
	POSCO FUTURE M CO LTD	2,535	320,500.000	812,467,500.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,749	137,700.000	240,837,300.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	2,521	61,800.000	155,797,800.000	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,314	110,900.000	367,522,600.000	
	HYUNDAI MOBIS	4,901	217,000.000	1,063,517,000.000	
	SK HYNIX INC	44,244	133,500.000	5,906,574,000.000	

HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,695	34,700.000	197,616,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,864	109,200.000	203,548,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	11,041	186,700.000	2,061,354,700.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,036	79,100.000	161,047,600.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,149	33,100.000	236,631,900.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,785	11,470.000	249,873,950.000	
KIA CORPORATION	20,809	90,500.000	1,883,214,500.000	
KOREA ZINC CO LTD	676	480,500.000	324,818,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,377	18,890.000	403,811,530.000	
KOREAN AIR CO LTD	14,033	23,600.000	331,178,800.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,209	123,900.000	149,795,100.000	
KT CORP	5,536	33,700.000	186,563,200.000	
HLB INC	8,598	47,750.000	410,554,500.000	
LG ELECTRONICS INC	8,590	97,200.000	834,948,000.000	
LG CORP	7,447	78,800.000	586,823,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,234	9,980.000	92,155,320.000	
NAVER CORP	10,646	231,000.000	2,459,226,000.000	
L&F CO LTD	2,034	201,000.000	408,834,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,443	53,800.000	185,233,400.000	
KANGWON LAND INC	9,245	15,450.000	142,835,250.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,858	450,500.000	2,639,029,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12,226	25,350.000	309,929,100.000	
COSMOAM&T CO LTD	2,095	145,900.000	305,660,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,431	416,500.000	1,845,511,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,412	147,800.000	652,093,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	386,689	73,600.000	28,460,310,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	53,776	7,320.000	393,640,320.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,128	136,300.000	426,346,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	65,955	59,900.000	3,950,704,500.000	
YUHAN CORP	4,700	64,800.000	304,560,000.000	
HANON SYSTEMS	13,064	6,850.000	89,488,400.000	
GS HOLDINGS CORP	3,803	41,000.000	155,923,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,254	13,400.000	244,603,600.000	
CELLTRION INC	12,429	206,000.000	2,560,374,000.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3,934	58,400.000	229,745,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	23,702	41,150.000	975,337,300.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,673	178,000.000	297,794,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,852	109,000.000	201,868,000.000	
POSCO DX CO LTD	4,364	59,700.000	260,530,800.000	

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,524	64,900.000	423,407,600.000	
	AMOREPACIFIC CORP	2,280	131,300.000	299,364,000.000	
	JYP ENTERTAINMENT CORP	2,605	100,300.000	261,281,500.000	
	SK INNOVATION CO LTD	4,838	128,900.000	623,618,200.000	
	ECOPRO CO LTD	1,628	620,000.000	1,009,360,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	713	300,000.000	213,900,000.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,252	225,000.000	281,700,000.000	
	SK INC	2,931	164,400.000	481,856,400.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	31,057	51,300.000	1,593,224,100.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,645	55,200.000	311,604,000.000	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,375	57,900.000	484,912,500.000	
	HANMI PHARM CO LTD	585	350,000.000	204,750,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,531	44,900.000	248,341,900.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	3,720	62,800.000	233,616,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,013	116,800.000	235,118,400.000	
	NETMARBLE CORP	2,112	58,500.000	123,552,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	49,019	12,480.000	611,757,120.000	
	ECOPRO BM CO LTD	3,992	293,500.000	1,171,652,000.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,801	97,400.000	272,817,400.000	
	KRAFTON INC	2,300	203,000.000	466,900,000.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,996	122,100.000	243,711,600.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,878	83,000.000	155,874,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	8,026	48,100.000	386,050,600.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,340	68,100.000	159,354,000.000	
	HYBE CO LTD	1,649	250,500.000	413,074,500.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,782	410,500.000	1,552,511,000.000	
	KAKAOBANK CORP	13,292	27,050.000	359,548,600.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,268	80,300.000	101,820,400.000	
	KAKAOPAY CORP	2,237	47,700.000	106,704,900.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,071	171,500.000	526,676,500.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,453	123,800.000	798,881,400.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,418	746,000.000	1,057,828,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,320	37,300.000	86,536,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,542	46,000.000	208,932,000.000	
韓国・ウォン　小計		1,271,608		90,540,469,700.000 (10,022,829,996)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	88,000	10.900	959,200.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	7.610	776,220.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	160,000	3.030	484,800.000	

ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	8,700	113.010	983,187.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	109,000	17.120	1,866,080.000	
BEIJING ENTERPRISES	42,500	28.450	1,209,125.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	350,000	4.400	1,540,000.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	482,000	3.670	1,768,940.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	181,000	15.980	2,892,380.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	54,000	27.550	1,487,700.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	234,000	4.390	1,027,260.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	713,600	6.900	4,923,840.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	324,120	12.700	4,116,324.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	266,888	25.800	6,885,710.400	
CITIC LTD	469,000	7.460	3,498,740.000	
LENOVO GROUP LTD	582,000	10.380	6,041,160.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,696,000	5.340	9,056,640.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	116,390	6.220	723,945.800	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,989,200	3.920	7,797,664.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	74,000	12.340	913,160.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	221,000	10.020	2,214,420.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	63,500	56.850	3,609,975.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	286,000	7.060	2,019,160.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	94,000	5.590	525,460.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	157,200	5.360	842,592.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	120,000	10.280	1,233,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	310,000	3.740	1,159,400.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	199,000	7.420	1,476,580.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	54,500	17.760	967,920.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	491,000	8.080	3,967,280.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	83,200	23.550	1,959,360.000	
BYD CO LTD	84,500	204.600	17,288,700.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	7.830	1,252,800.000	

CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	284,592	2.630	748,476.960	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	218,000	5.080	1,107,440.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,000	106.800	1,068,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	553,788	9.640	5,338,516.320	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.160	692,040.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	153,200	15.800	2,420,560.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	190,000	8.970	1,704,300.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	597,000	8.920	5,325,240.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	429,000	12.420	5,328,180.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	194,400	6.330	1,230,552.000	
WEICHAI POWER CO LTD	152,440	13.240	2,018,305.600	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	114,000	7.330	835,620.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	8.600	1,548,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	52,000	50.000	2,600,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	262,000	6.050	1,585,100.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	220,000	3.340	734,800.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	129,333	30.700	3,970,523.100	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	94,000	5.580	524,520.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	823,250	3.380	2,782,585.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	247,000	18.960	4,683,120.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	539,400	280.200	151,139,880.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	541,500	31.700	17,165,550.000	
LI NING CO LTD	192,000	17.740	3,406,080.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	456,000	1.920	875,520.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	438,000	2.910	1,274,580.000	
AIR CHINA / HONG KONG	156,000	4.550	709,800.000	
ZTE CORP	63,288	15.420	975,900.960	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	270,500	28.650	7,749,825.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,250	7.600	1,886,700.000	

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

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

CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	287,500	3.900	1,121,250.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	667,000	3.510	2,341,170.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	102,000	17.720	1,807,440.000	
EAST BUY HOLDING LTD	32,500	29.800	968,500.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	175,000	6.100	1,067,500.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	41,400	16.440	680,616.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	64,000	14.160	906,240.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,522,000	0.790	2,782,380.000	
XIAOMI CORP	1,239,000	14.100	17,469,900.000	
BEIGENE LTD	56,400	110.400	6,226,560.000	
WUXI APPTEC CO LTD	30,612	74.050	2,266,818.600	
MEITUAN	410,510	71.750	29,454,092.500	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	112,400	15.640	1,757,936.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	136,000	14.440	1,963,840.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	386,000	4.090	1,578,740.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	99,500	41.600	4,139,200.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	500,000	0.720	360,000.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	40,300	31.750	1,279,525.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	133,000	5.930	788,690.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	88,000	13.920	1,224,960.000	
CHINA FEIHE LTD	336,000	3.890	1,307,040.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,316,768	69.300	91,252,022.400	
JD.COM INC	189,535	98.200	18,612,337.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	140,000	5.660	792,400.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	70.150	533,140.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	188,800	48.350	9,128,480.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	198,800	21.800	4,333,840.000	
BILIBILI INC	15,640	85.050	1,330,182.000	
AKESO INC	40,000	48.100	1,924,000.000	
NETEASE INC	156,800	140.100	21,967,680.000	

	HORIZON CONSTRUCTION DEVELOPMENT LTD	4,703	4.530	21,304.590	
	GDS HOLDINGS LTD	90,500	7.230	654,315.000	
	ZAI LAB LTD	70,500	21.000	1,480,500.000	
	NONGFU SPRING CO LTD	158,200	41.150	6,509,930.000	
	LI AUTO INC	93,200	125.200	11,668,640.000	
	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	88,050	31.800	2,799,990.000	
	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	30,400	30.800	936,320.000	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	62,400	25.200	1,572,480.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	163,161	6.490	1,058,914.890	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	121,200	58.650	7,108,380.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	35,600	19.940	709,864.000	
	JD LOGISTICS INC	148,100	8.930	1,322,533.000	
	TRIP.COM GROUP LTD	44,350	296.800	13,163,080.000	
	XPENG INC	79,000	48.450	3,827,550.000	
	MINISO GROUP HOLDING LTD	28,600	42.900	1,226,940.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	42,000	17.640	740,880.000	
	CGN POWER CO LTD	826,000	2.090	1,726,340.000	
	GF SECURITIES CO LTD	83,200	8.330	693,056.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	48,400	39.250	1,899,700.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	115,800	9.710	1,124,418.000	
	3SBIO INC	127,500	6.910	881,025.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	95,500	5.220	498,510.000	
	CHINA LITERATURE LTD	38,600	26.100	1,007,460.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	25,000	13.800	345,000.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	100,000	5.720	572,000.000	
	BOC AVIATION LTD	18,100	57.450	1,039,845.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	61,200	16.560	1,013,472.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	98,000	12.240	1,199,520.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	122,800	10.100	1,240,280.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	309,500	28.000	8,666,000.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	520,000	1.670	868,400.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,040	27.700	915,208.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	60,000	15.160	909,600.000	

香港・ドル　小計		67,815,959		824,606,809.740 (15,362,424,865)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	41,505	508.000	21,084,540.000	
	ACER INC	241,110	47.200	11,380,392.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	57,738	461.000	26,617,218.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	39,334	456.000	17,936,304.000	
	ASIA CEMENT CORP	203,290	40.700	8,273,903.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	556,935	13.500	7,518,622.500	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	79,495	79.100	6,288,054.500	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	41,042	247.500	10,157,895.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,335	186.000	10,664,310.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	110,686	162.500	17,986,475.000	
	QUANTA COMPUTER INC	221,492	218.000	48,285,256.000	
	EVA AIRWAYS CORP	191,977	32.000	6,143,264.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	44,975	197.000	8,860,075.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	469,004	17.650	8,277,920.600	
	CHINA AIRLINES	231,823	20.850	4,833,509.550	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	160,684	43.950	7,062,061.800	
	CHINA STEEL CORP	949,704	25.850	24,549,848.400	
	ADVANTECH CO LTD	37,817	360.000	13,614,120.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	343,344	35.850	12,308,882.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	157,087	291.000	45,712,317.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	112,226	71.500	8,024,159.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	304,804	120.000	36,576,480.000	
	AUO CORP	526,500	18.350	9,661,275.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	139,574	98.800	13,789,911.200	
	EVERGREEN MARINE CORP	83,315	148.000	12,330,620.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	225,768	31.200	7,043,961.600	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	40,131	169.500	6,802,204.500	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	14,780	552.000	8,158,560.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,194	502.000	23,691,388.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	303,987	77.000	23,406,999.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	281,888	60.300	16,997,846.400	
	MEDIATEK INC	123,366	924.000	113,990,184.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	631,886	64.000	40,440,704.000	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	678,042	21.950	14,883,021.900	

HOTAI MOTOR CO LTD	24,801	676.000	16,765,476.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	125,016	80.100	10,013,781.600	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	808,482	26.500	21,424,773.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	789,260	44.700	35,279,922.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,307,205	12.250	16,013,261.250	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,122,221	25.400	28,504,413.400	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,009,392	100.000	100,939,200.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	931,327	39.350	36,647,717.450	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,131	2,525.000	20,530,775.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	900,807	17.800	16,034,364.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,048,098	8.720	9,139,414.560	
INVENTEC CO LTD	216,699	49.050	10,629,085.950	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	165,759	107.000	17,736,213.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	842,432	19.300	16,258,937.600	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,415,862	28.050	39,714,929.100	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	850,200	26.900	22,870,380.000	
NAN YA PLASTICS CORP	380,616	64.500	24,549,732.000	
WISTRON CORP	214,789	94.500	20,297,560.500	
POU CHEN CORP	168,225	30.950	5,206,563.750	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	378,799	72.500	27,462,927.500	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,363	268.000	12,425,284.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	87,341	79.100	6,908,673.100	
E INK HOLDINGS INC	69,588	187.000	13,012,956.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121,517	36.950	4,490,053.150	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	112,538	68.800	7,742,614.400	
TAIWAN CEMENT CORP	552,189	33.700	18,608,769.300	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,992,751	584.000	1,163,766,584.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	902,277	50.100	45,204,077.700	
WAN HAI LINES LTD	51,482	50.700	2,610,137.400	
WALSIN LIHWA CORP	237,342	36.000	8,544,312.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	247,693	28.100	6,960,173.300	

	YAGEO CORP	27,060	555.000	15,018,300.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	152,894	48.800	7,461,227.200	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	145,465	30.100	4,378,496.500	
	GLOBAL UNICHIP CORP	6,904	1,790.000	12,358,160.000	
	INNOLUX CORPORATION	691,396	14.600	10,094,381.600	
	WPG HOLDINGS CO LTD	133,999	82.000	10,987,918.000	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	17,565	225.500	3,960,907.500	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	4,925	2,570.000	12,657,250.000	
	PEGATRON CORP	160,827	82.900	13,332,558.300	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	6,039	3,650.000	22,042,350.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,248	966.000	10,865,568.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	124,224	183.000	22,732,992.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,851	1,130.000	6,611,630.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	61,247	103.000	6,308,441.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	800,565	26.200	20,974,803.000	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	301,591	44.950	13,556,515.450	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	4,934	1,620.000	7,993,080.000	
	WIWYNN CORP	8,037	1,770.000	14,225,490.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	246,182	126.500	31,142,023.000	
	SILERGY CORP	26,552	451.500	11,988,228.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	275,444	29.050	8,001,648.200	
	PHARMAESSENTIA CORP	17,593	328.000	5,770,504.000	
	MOMO.COM INC	6,487	482.500	3,129,977.500	
	GLOBALWAFERS CO LTD	17,128	588.000	10,071,264.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,658	351.000	5,144,958.000	
台湾・ドル　小計		28,147,855		2,730,454,017.210 (12,767,602,984)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	23,375	245.470	5,737,861.250	
	CLICKS GROUP LTD	19,196	314.250	6,032,343.000	
	DISCOVERY LTD	43,836	137.970	6,048,052.920	
	GOLD FIELDS LTD	73,014	230.710	16,845,059.940	
	REMGRO LTD	42,134	155.850	6,566,583.900	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	43,521	106.050	4,615,402.050	
	EXXARO RESOURCES LTD	22,354	198.890	4,445,987.060	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,033	1,970.180	13,856,275.940	
	MTN GROUP LTD	135,709	111.320	15,107,125.880	

	FIRSTRAND LTD	407,476	71.360	29,077,487.360	
	NASPERS LTD	15,109	2,931.260	44,288,407.340	
	NEDBANK GROUP LTD	36,051	215.110	7,754,930.610	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,517	847.000	4,672,899.000	
	SASOL LTD	46,231	168.390	7,784,838.090	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,113	272.500	10,930,792.500	
	STANDARD BANK GROUP LTD	108,537	206.860	22,451,963.820	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,293	70.850	5,476,209.050	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,167	202.360	6,104,594.120	
	ABSA GROUP LTD	67,695	158.870	10,754,704.650	
	SANLAM LTD	142,680	71.110	10,145,974.800	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	69,363	77.800	5,396,441.400	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,386	551.400	2,969,840.400	
	OUTSURANCE GROUP LTD	70,350	40.970	2,882,239.500	
	VODACOM GROUP PTY LTD	51,270	106.410	5,455,640.700	
	NEPI ROCKCASTLE NV	35,926	121.400	4,361,416.400	
	OLD MUTUAL LTD	391,487	12.050	4,717,418.350	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,809	442.220	5,222,175.980	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	169,735	19.080	3,238,543.800	
	SIBANYE STILLWATER LTD	224,039	22.950	5,141,695.050	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	29,798	125.210	3,731,007.580	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	34,625	316.900	10,972,662.500	
	BID CORP LTD	26,932	423.320	11,400,854.240	
南アフリカ・ランド　小計		2,507,761		304,187,429.180 (2,369,620,073)	
合計		603,909,158		79,807,323,477 (79,807,323,477)	

（２）株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

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

投資信託受益証券　合計			1,628,810	694,439,423 (694,439,423)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	7,010,212.000	
	メキシコ・ペソ　小計		235,400.000	7,010,212.000 (60,138,506)	
投資証券　合計			235,400	60,138,506 (60,138,506)	
合計				754,577,929 (754,577,929)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

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

香港・ドル	株式	184銘柄	18.29	－	－	19.07
台湾・ドル	株式	90銘柄	15.20	－	－	15.85
南アフリカ・ランド	株式	32銘柄	2.82	－	－	2.94

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,325,879,582
国債証券	449,985,136,950
地方債証券	29,572,914,057
特殊債券	28,942,313,821
社債券	23,776,995,600
未収利息	569,184,780
前払費用	187,561,923
流動資産合計	546,359,986,713
資産合計	546,359,986,713
負債の部	
流動負債	
未払解約金	11,150,481,000
流動負債合計	11,150,481,000
負債合計	11,150,481,000
純資産の部	
元本等	
元本	428,394,158,975
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	106,815,346,738
元本等合計	535,209,505,713
純資産合計	535,209,505,713
負債純資産合計	546,359,986,713

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	441,014,150,576円
同期中追加設定元本額	703,721,924,034円
同期中一部解約元本額	716,341,915,635円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	26,323,195,736円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	56,606,049円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	87,780,257円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	47,232,489円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	786,337,358円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	271,566,704円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	40,551,374円
たわらノーロード　国内債券	19,133,000,602円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	5,390,841,248円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,531,285,370円
たわらノーロード　バランス（標準型）	2,956,223,656円
たわらノーロード　バランス（積極型）	402,583,668円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	188,971,204円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	2,381,144,280円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	2,632,680,066円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	781,926,868円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	36,728,481円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	20,456,124円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	190,464,601円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,184,517円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	62,284円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	13,455,481,019円
Ｏｎｅグローバルバランス	85,210,855円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	10,789,126,599円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	15,949,804,536円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	7,124,073,657円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,616,386,900円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,713,239,401円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	511,301,143円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	74,055,112円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,838,349,962円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	4,416,875円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	5,244,186,785円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,300,254,579円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	470,311,561円
投資のソムリエ	90,823,131,816円
クルーズコントロール	1,177,222,514円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	8,735,274,950円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	6,253,186,441円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	2,013,763,597円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	10,215,598,049円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	33,990,547,314円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	512,308,015円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	259,279,199円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	87,665,290円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	2,029,090,803円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,415,331,043円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,496,010,970円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	6,139,613,247円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	673,740,560円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	281,249,865円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	171,621,194円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	2,052,675,221円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	40,968,719円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	161,408,933円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	1,167,534,651円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	1,172,032,430円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,540,610,006円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	706,532,898円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	1,144,358,419円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	2,980,757,352円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	1,968,335,495円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	1,035,526,887円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	2,024,268,104円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	10,036,402,497円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,179,872,920円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	2,848,441,408円
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）	587,158,827円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	260,978,011円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	2,397,299,626円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	2,408,636,925円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	2,381,224,582円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,927,959,684円

リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	39,280,280円
ＡＭＯｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	465,443,530円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	145,318,158円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	92,745,141円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,136,550円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,261,491円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,706,177円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	368,250円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,014,557円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	96,147,081円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,671,243,954円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,093,866,159円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,262,166,282円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	57,201,783円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	129,853,208円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,579,643,015円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	102,060,284円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	561,767円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,550,657,363円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,788,301円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	271,448,835円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	474,252,724円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	784,664,877円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	202,682,917円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	58,249,238円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	387,569,601円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	206,780,526円
コア資産形成ファンド	109,306,062円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ専用＞	21,833,980,218円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	24,275,836,139円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	18,503,617,489円
ＭＨＡＭ動的パッケージ４資産ファンド［適格機関投資家限定］	117,422,889円
計	428,394,158,975円
２．　受益権の総数	428,394,158,975口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

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

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月15日から2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2493円

（1万口当たり純資産額）	(12,493円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	４４６回　利付国庫債券（２年）	1,500,000,000	1,501,260,000	
	４４７回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,000,850,000	
	４４８回　利付国庫債券（２年）	2,000,000,000	2,001,540,000	
	４４９回　利付国庫債券（２年）	1,800,000,000	1,801,242,000	
	４５１回　利付国庫債券（２年）	12,500,000,000	12,509,625,000	
	４５５回　利付国庫債券（２年）	2,400,000,000	2,400,672,000	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,700,000,000	3,707,215,000	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	7,300,000,000	7,315,987,000	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	4,700,000,000	4,710,434,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	5,750,000,000	5,751,207,500	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	3,610,000,000	3,610,433,200	
	１４９回　利付国庫債券（５年）	1,680,000,000	1,680,000,000	
	１５０回　利付国庫債券（５年）	1,470,000,000	1,469,559,000	
	１５１回　利付国庫債券（５年）	1,900,000,000	1,898,784,000	
	１５２回　利付国庫債券（５年）	1,890,000,000	1,894,498,200	
	１５３回　利付国庫債券（５年）	5,210,000,000	5,202,810,200	
	１５４回　利付国庫債券（５年）	1,400,000,000	1,401,792,000	
	１５５回　利付国庫債券（５年）	6,200,000,000	6,251,026,000	
	１５６回　利付国庫債券（５年）	4,300,000,000	4,318,533,000	
	１５７回　利付国庫債券（５年）	4,400,000,000	4,414,652,000	

１５８回　利付国庫債券（５年）	3,600,000,000	3,596,976,000	
１５９回　利付国庫債券（５年）	2,100,000,000	2,095,821,000	
１６０回　利付国庫債券（５年）	900,000,000	902,178,000	
１６１回　利付国庫債券（５年）	1,700,000,000	1,711,220,000	
１６２回　利付国庫債券（５年）	1,000,000,000	1,005,570,000	
１６３回　利付国庫債券（５年）	2,700,000,000	2,727,594,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	130,343,400	
２回　利付国庫債券（４０年）	330,000,000	376,348,500	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	614,525,400	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	818,899,200	
５回　利付国庫債券（４０年）	710,000,000	775,710,500	
６回　利付国庫債券（４０年）	940,000,000	1,005,095,000	
７回　利付国庫債券（４０年）	880,000,000	896,992,800	
８回　利付国庫債券（４０年）	990,000,000	935,183,700	
９回　利付国庫債券（４０年）	1,890,000,000	1,306,840,500	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,930,000,000	1,564,265,000	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,040,000,000	808,776,800	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,420,000,000	982,143,000	
１３回　利付国庫債券（４０年）	2,090,000,000	1,430,375,100	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,100,000,000	1,532,517,000	
１５回　利付国庫債券（４０年）	2,340,000,000	1,880,190,000	
１６回　利付国庫債券（４０年）	1,200,000,000	1,054,860,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	3,230,000,000	3,247,765,000	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	3,980,000,000	4,005,153,600	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	3,300,000,000	3,323,958,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	3,620,000,000	3,642,082,000	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	3,520,000,000	3,528,060,800	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,090,000,000	4,099,938,700	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	3,570,000,000	3,579,103,500	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	4,890,000,000	4,902,176,100	

３４６回　利付国庫債券（１０年）	4,540,000,000	4,550,805,200	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	4,500,000,000	4,508,460,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,070,000,000	4,075,209,600	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	5,850,000,000	5,852,281,500	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	6,600,000,000	6,594,456,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	2,400,000,000	2,395,224,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	4,950,000,000	4,931,586,000	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	3,690,000,000	3,672,841,500	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	2,460,000,000	2,446,740,600	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	4,130,000,000	4,105,550,400	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	2,700,000,000	2,682,531,000	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	5,800,000,000	5,755,804,000	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	5,150,000,000	5,104,474,000	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	4,050,000,000	4,007,677,500	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	3,500,000,000	3,456,355,000	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	6,000,000,000	5,912,400,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	4,210,000,000	4,137,672,200	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	5,070,000,000	4,969,107,000	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	5,350,000,000	5,228,341,000	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	5,430,000,000	5,292,458,100	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	4,880,000,000	4,783,668,800	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	5,700,000,000	5,572,833,000	
３６８回　利付国庫債券（１０年）	4,550,000,000	4,436,341,000	
３６９回　利付国庫債券（１０年）	5,220,000,000	5,213,266,200	
３７０回　利付国庫債券（１０年）	4,500,000,000	4,486,185,000	

３７１回　利付国庫債券（１０年）	5,200,000,000	5,125,432,000	
３７２回　利付国庫債券（１０年）	5,200,000,000	5,309,772,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	126,083,100	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	113,102,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	235,162,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	230,724,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	276,282,500	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	263,030,300	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	170,251,500	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	399,690,400	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	308,815,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	285,511,200	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	318,897,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	468,808,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	328,302,800	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	394,597,500	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	364,039,200	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	347,428,700	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	419,667,500	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	388,485,900	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	737,862,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	746,343,600	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	927,287,900	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,024,690,000	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,035,575,200	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	836,589,600	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,140,089,500	

３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,330,674,200	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,386,756,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,190,676,800	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,535,879,600	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,500,732,800	
３８回　利付国庫債券（３０年）	850,000,000	921,621,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,210,000,000	1,330,891,100	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	1,114,212,800	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,127,129,800	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,062,250,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,410,000,000	1,496,221,500	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	1,197,822,600	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	1,176,231,500	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,870,000,000	1,909,905,800	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,340,000,000	1,391,067,400	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,720,000,000	1,718,555,200	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,296,724,000	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	1,014,311,500	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,190,813,600	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,228,410,000	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,018,712,200	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,790,000,000	1,559,698,600	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,080,000,000	938,325,600	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	900,952,000	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,730,000,000	1,494,322,100	

５８回　利付国庫債券（３０年）	1,660,000,000	1,429,675,000	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	937,977,600	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,430,000,000	1,251,736,200	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	880,531,400	
６２回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	565,646,400	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	837,144,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	985,491,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	982,527,000	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,090,000,000	819,887,100	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,270,000,000	1,006,017,800	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,340,000,000	1,057,742,400	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,100,580,000	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	967,896,000	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	948,578,400	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,290,000,000	1,034,476,800	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,111,972,200	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,203,448,100	
７５回　利付国庫債券（３０年）	1,320,000,000	1,230,570,000	
７６回　利付国庫債券（３０年）	1,320,000,000	1,259,412,000	
７７回　利付国庫債券（３０年）	1,600,000,000	1,600,000,000	
７８回　利付国庫債券（３０年）	1,800,000,000	1,714,734,000	
７９回　利付国庫債券（３０年）	1,600,000,000	1,448,736,000	
８０回　利付国庫債券（３０年）	1,700,000,000	1,775,565,000	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	184,615,200	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	71,628,900	

７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	40,978,000	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	256,965,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,465,000	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	92,765,700	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	413,708,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	145,034,400	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	72,867,900	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	176,636,800	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	617,116,400	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	126,039,600	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	125,778,000	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	623,045,900	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,535,800	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	497,720,600	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	116,783,700	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,230,992,000	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	393,243,400	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	714,220,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	592,542,500	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	128,458,800	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	711,836,400	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	171,977,600	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	809,295,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	902,044,000	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	251,879,900	

１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	549,810,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	175,233,600	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	119,504,000	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	697,280,000	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	547,075,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	656,208,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	747,891,000	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	380,621,500	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	483,010,000	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	509,468,400	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	815,598,400	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,515,946,100	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	410,000,000	455,169,700	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	401,770,800	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	593,653,000	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	523,584,700	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	616,510,650	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	515,975,400	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	708,294,400	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	627,079,800	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	392,945,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	678,966,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	569,960,700	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	599,697,000	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	411,410,400	

１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,006,141,500	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,987,400	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	697,580,100	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	221,748,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	143,107,900	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	393,451,200	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	528,758,400	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,150,449,800	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,071,590,800	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	937,261,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,169,816,000	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	478,228,800	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,230,000,000	1,347,022,200	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	814,777,500	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,250,000,000	2,486,542,500	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,476,924,800	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	1,290,000,000	1,414,278,600	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	2,730,000,000	2,967,209,700	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,290,000,000	2,488,726,200	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	2,930,000,000	3,152,738,600	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	3,160,000,000	3,332,346,400	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,440,000,000	2,570,515,600	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,740,000,000	2,912,510,400	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	3,020,000,000	3,172,842,200	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,339,872,800	

１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,176,328,400	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,580,000,000	2,392,717,800	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,140,000,000	2,054,207,400	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,840,000,000	1,783,254,400	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	1,820,000,000	1,781,288,600	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	1,760,000,000	1,694,668,800	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	1,930,000,000	1,852,664,900	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,430,000,000	2,323,881,900	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,750,000,000	2,584,010,000	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	2,250,000,000	2,106,742,500	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	1,240,000,000	1,190,065,200	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	2,350,000,000	2,181,693,000	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	1,590,000,000	1,448,013,000	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	1,520,000,000	1,355,961,600	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,687,599,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,740,000,000	1,537,690,200	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,080,000,000	966,178,800	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,360,000,000	2,100,801,200	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	2,400,000,000	2,125,656,000	
１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,020,000,000	1,810,768,400	
１７６回　利付国庫債券（２０年）	2,500,000,000	2,230,025,000	
１７７回　利付国庫債券（２０年）	1,750,000,000	1,527,207,500	
１７８回　利付国庫債券（２０年）	2,800,000,000	2,477,860,000	
１７９回　利付国庫債券（２０年）	2,200,000,000	1,938,354,000	
１８０回　利付国庫債券（２０年）	2,520,000,000	2,334,679,200	

	１８１回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,785,639,000	
	１８２回　利付国庫債券（２０年）	2,150,000,000	2,086,897,500	
	１８３回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,731,093,000	
	１８４回　利付国庫債券（２０年）	1,880,000,000	1,815,290,400	
	１８５回　利付国庫債券（２０年）	2,100,000,000	2,022,279,000	
	１８６回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,750,541,000	
国債証券　合計		456,285,000,000	449,985,136,950	
地方債証券	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,799,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	109,802,000	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	196,652,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	394,176,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	294,735,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	227,816,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	110,420,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	102,442,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	103,498,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	211,292,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	317,739,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	109,658,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,767,000	
	３１回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	208,940,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,852,000	
	３０年度８回　北海道公募公債	400,000,000	399,152,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	397,556,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	97,723,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	245,170,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	100,578,000	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	198,298,000	
	２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	196,224,000	
	２５８回　神奈川県公募公債　１０年	300,000,000	292,524,000	
	３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	119,741,000	
	１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	109,495,000	

１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	333,870,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	109,857,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,696,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,134,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	194,638,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,338,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	194,450,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	193,420,000	
４７４回　大阪府公募公債　１０年	300,000,000	290,031,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	218,232,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	103,435,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	94,923,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	298,773,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	109,190,057	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	394,124,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	196,512,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	200,908,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	196,546,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	97,783,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	116,147,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	207,772,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	313,527,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	103,622,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	101,790,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	196,764,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	98,179,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	195,404,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,276,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,710,000	

８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	205,470,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	103,532,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	328,191,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	333,495,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	111,870,000	
２６年度４回　愛知県公募公債　２０年	200,000,000	215,302,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	151,926,000	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	100,707,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	197,798,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	219,966,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	99,810,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	196,434,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	84,404,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	88,048,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	197,330,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	176,484,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	224,676,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	111,062,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	108,356,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	323,184,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	103,524,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	100,326,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	198,928,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	196,730,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	98,102,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,353,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	149,170,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	108,490,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,213,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	325,476,000	
２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	201,618,000	

２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	99,965,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	193,646,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	104,198,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	103,122,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	93,593,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	195,928,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	107,533,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,012,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	603,984,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,670,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,172,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,719,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,916,000	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,780,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,200,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,755,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,975,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,644,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,870,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,078,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,290,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,512,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,442,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	492,450,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,379,000	
２２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	487,555,000	

２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	485,290,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	99,392,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	195,982,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	199,778,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	295,269,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	218,536,000	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	196,412,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	107,434,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	103,774,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	106,381,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	223,122,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	218,460,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	299,430,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	156,602,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	393,336,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	117,585,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	108,587,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	107,537,000	
２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	111,746,000	
２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	283,221,000	
第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	198,982,000	
６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	219,882,000	
５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	111,538,000	
６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	108,340,000	
１１回　北九州市公募公債　２０年	300,000,000	332,991,000	
１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	107,437,000	
２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	114,974,000	
３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	188,422,000	
２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	87,230,000	
２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	100,429,000	
２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	189,558,000	
２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	300,051,000	

	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	94,624,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	298,779,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	197,202,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	195,982,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	198,156,000	
地方債証券　合計		29,439,330,000	29,572,914,057	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	207,546,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	206,616,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,192,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	433,745,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,850,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	78,892,000	
	１５６回　日本政策投資銀行債券	400,000,000	388,364,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,601,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	374,580,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	180,810,000	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	238,274,000	
	３６回　高速道路機構債	300,000,000	366,948,000	
	５０回　高速道路機構債	300,000,000	267,522,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,111,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,958,000	
	１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,938,000	
	１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,921,000	
	１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,212,000	
	１６９回　高速道路機構債	100,000,000	93,220,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	182,852,000	
	２１０回　高速道路機構債	100,000,000	93,413,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,409,000	
	１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,988,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	546,600,000	
	１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,817,000	
	１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,656,000	

２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,578,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	502,615,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,639,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,636,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	196,240,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	512,310,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	95,873,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,595,000	
２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	185,060,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,045,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	800,656,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	190,490,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	94,039,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	223,485,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	141,850,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	154,130,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	156,042,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	595,285,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	216,542,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	330,354,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	331,140,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	111,063,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,250,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	218,908,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	108,325,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	217,060,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,032,000	

Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	329,517,000	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	107,183,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	528,260,000	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	303,159,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,464,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	207,956,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,777,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	399,400,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,970,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	95,002,000	
９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,080,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,087,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,942,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,783,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	255,777,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	226,101,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,780,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	218,648,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,874,340	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	103,766,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	103,818,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	205,856,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	158,100,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	105,236,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	100,512,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	219,588,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,254,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	387,667,000	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,819,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,297,000	

１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,574,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	269,232,500	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,061,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,672,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,851,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,502,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,748,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	92,483,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,925,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,925,000	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,104,000	40,243,962	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,620,000	15,193,981	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,240,000	96,906,421	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,952,000	144,801,879	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,594,000	20,364,632	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,838,000	17,470,098	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,712,000	20,383,390	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,700,000	21,404,421	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,315,000	26,122,801	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,388,000	63,899,037	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,102,000	28,866,374	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,428,000	34,981,946	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,999,000	35,565,633	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,719,000	39,263,389	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,092,000	40,358,210	

９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,452,000	44,931,574	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,168,000	50,940,302	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,028,000	53,104,360	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	201,015,000	193,748,307	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,188,000	66,068,716	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,697,000	65,681,660	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,085,000	65,989,343	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	212,925,000	205,255,441	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	212,475,000	204,704,789	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,020,000	139,668,762	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	217,236,000	208,700,797	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	215,403,000	207,013,053	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	375,415,000	361,821,222	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,797,000	72,024,275	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,196,000	73,485,188	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,324,000	236,030,044	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	332,308,000	315,496,538	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	255,960,000	242,982,828	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	261,657,000	248,503,502	
１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	797,535,000	756,087,106	
６回　沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	411,088,000	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,727,000	
い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,872,000	
い第８５１号　利付商工債	300,000,000	298,833,000	
い第８５４号　利付商工債	300,000,000	298,500,000	
い第８５５号　利付商工債	200,000,000	198,976,000	
３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	399,420,000	

	３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	299,037,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	108,548,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,182,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	297,897,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	299,487,000	
	８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	398,860,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,205,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,694,000	
特殊債券　合計		28,861,687,000	28,942,313,821	
社債券	２５回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１７）	300,000,000	295,497,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	99,158,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	399,072,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	86,590,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,793,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	197,170,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	298,944,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,296,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	199,276,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	497,860,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	100,649,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	300,564,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	200,738,000	
	６１回　西日本高速道路債券	500,000,000	498,120,000	
	６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	497,860,000	
	２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	199,014,000	
	１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	100,493,000	
	３回　ダイドーグループＨＤ社債	300,000,000	294,615,000	
	９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	94,903,000	
	１２回　セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	100,811,000	
	１４回　セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,752,000	
	３０回　東レ社債	300,000,000	299,688,000	
	４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	198,982,000	
	２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	185,020,000	
	４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,412,000	
	１７回　ダイセル社債	300,000,000	293,154,000	
	１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	475,410,000	

４回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	300,000,000	294,363,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	296,910,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	298,305,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	100,221,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	97,050,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	192,212,000	
５８回　川崎重工業社債	300,000,000	286,878,000	
５回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	99,337,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	199,128,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	91,868,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	393,012,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	399,020,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	106,383,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,775,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	298,173,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	298,425,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	298,509,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	391,828,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,494,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,658,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,549,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	194,894,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	290,508,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	98,374,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,144,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,688,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	194,514,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	299,022,000	
３回　野村ホールディングス社債	300,000,000	297,291,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	100,158,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,100,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	103,575,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	89,261,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	308,007,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	206,410,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	109,293,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,348,000	

７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	219,368,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	94,070,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,196,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	92,042,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,972,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	70,365,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,647,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	171,122,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	150,240,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,779,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	195,716,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	76,646,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	70,780,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,546,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	170,608,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,162,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	126,171,600	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	69,044,000	
７回　ニッコンＨＤ社債	300,000,000	292,530,000	
６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	195,440,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	391,608,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	188,226,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	90,891,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	195,628,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	101,021,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	300,291,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	394,132,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	171,434,000	
５４１回　関西電力社債	300,000,000	286,836,000	
３９６回　中国電力社債	200,000,000	193,670,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	97,514,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	101,788,000	
３１１回　北陸電力社債	100,000,000	101,426,000	
４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,807,000	
５２１回　東北電力社債	400,000,000	392,236,000	
５２５回　東北電力社債	200,000,000	198,162,000	
５３６回　東北電力社債	300,000,000	285,399,000	
３２０回　四国電力社債	300,000,000	289,725,000	
４６３回　九州電力社債	100,000,000	89,063,000	
４６６回　九州電力社債	100,000,000	87,979,000	
４９１回　九州電力社債	300,000,000	288,420,000	
４９２回　九州電力社債	100,000,000	82,357,000	
４９３回　九州電力社債	200,000,000	198,918,000	
５０７回　九州電力社債	200,000,000	194,074,000	
３４０回　北海道電力社債	300,000,000	300,630,000	
３５０回　北海道電力社債	200,000,000	177,364,000	
１３回　電源開発社債	200,000,000	205,130,000	
５４回　電源開発社債	100,000,000	99,647,000	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,017,441,206
国債証券	242,369,186,801
派生商品評価勘定	5,162,869
未収入金	3,258,991,617
未収利息	1,759,614,675
前払費用	211,233,816
流動資産合計	251,621,630,984
資産合計	251,621,630,984
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,760,778
前受金	1,681,132,245
未払金	639,876,965
未払解約金	3,061,975,000
流動負債合計	5,384,744,988
負債合計	5,384,744,988
純資産の部	
元本等	
元本	107,965,110,236
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	138,271,775,760
元本等合計	246,236,885,996
純資産合計	246,236,885,996
負債純資産合計	251,621,630,984

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	90,161,381,348円
同期中追加設定元本額	55,556,419,101円
同期中一部解約元本額	37,752,690,213円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,881,223,250円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,145,444円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,898,297円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	33,694,653円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	29,803,678円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	42,934,640円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	28,591,206円
たわらノーロード　先進国債券	19,827,972,931円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	360,154,426円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,096,947,248円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	69,998,735円
たわらノーロード　バランス（標準型）	391,444,624円
たわらノーロード　バランス（積極型）	88,758,861円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	17,917,867円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	1,054,059,074円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,836,331,443円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	902,250,800円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	684,082,525円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,193,021円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	12,350,592円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	195,919,611円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	17,738,196円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	36,398,791円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,843,987,367円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	1,330,679,699円

Ｏｎｅグローバルバランス	50,482,197円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	734,747,927円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,430,100,443円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,851,739,673円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	415,782,480円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	854,188,656円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	801,750,820円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	23,358,394円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	893,929,925円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	15,215,627円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	159,329,380円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	160,868,965円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	258,954,767円
クルーズコントロール	995,614,214円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	182,522,998円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	805,451,241円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	699,203,724円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	179,600,769円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	458,147,579円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	5,251,423円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	97,565,533円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	989,890,513円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	222,420,965円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	223,425,556円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	95,585,889円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	133,815,347円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	591,440,828円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	522,061,984円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	197,100,054円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	574,015,166円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	4,849,417,418円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	1,382,576,553円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,512,645,740円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,273,590,222円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	214,210,726円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,615,125円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	367,355,200円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	319,552,429円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	204,015,516円

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,612,607円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,232,209円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,525,375円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,401円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,854,304円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,206,577円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,284,757,008円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,246,667,206円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,341,671,486円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	52,433,299円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	99,972,653円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,161,371,080円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	204,916,647円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	154,175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）	212,900,846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）	260,571,634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）	344,848,371円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,913,630円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	48,719,478円
コア資産形成ファンド	25,202,017円
たわらノーロード　外国債券（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	4,197,854,690円
たわらノーロード　外国債券（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	10,174,909,884円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	5,706,467,769円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	4,898,733,380円
計	107,965,110,236円
２．　受益権の総数	107,965,110,236口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月22日から2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち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	998,599,000	－	1,000,353,144	△1,754,144
アメリカ・ドル	337,153,000	－	337,167,826	△14,826
イギリス・ポンド	42,858,000	－	42,859,639	△1,639
オフショア・人民元	453,496,000	－	455,235,127	△1,739,127
ユーロ	165,092,000	－	165,090,552	1,448
買建	653,400,000	－	658,556,235	5,156,235
アメリカ・ドル	194,693,000	－	196,021,957	1,328,957

イギリス・ポンド	31,564,000	－	31,863,824	299,824
オフショア・人民元	245,126,000	－	246,764,230	1,638,230
ユーロ	182,017,000	－	183,906,224	1,889,224
合計	1,651,999,000	－	1,658,909,379	3,402,091

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年1月11日現在
1口当たり純資産額	2.2807円
（1万口当たり純資産額）	(22,807円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

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

		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,645,564.850	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,461,820.320	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,695,549.220	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,206,860.560	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,868,500.000	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,050,000.000	4,098,883.800	
		US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,663,511.700	
		US T N/B 0.625 08/15/30	7,740,000.000	6,230,548.800	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,424,915.990	
		US T N/B 0.625 12/31/27	4,820,000.000	4,222,677.730	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,846,786.330	
		US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,300,496.110	
		US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,544,140.620	
		US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,189,276.560	
		US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,530,410.170	
		US T N/B 0.875 06/30/26	4,510,000.000	4,163,734.180	
		US T N/B 0.875 09/30/26	4,010,000.000	3,677,216.990	
		US T N/B 0.875 11/15/30	9,480,000.000	7,730,643.730	
		US T N/B 1.0 07/31/28	4,770,000.000	4,177,569.720	
		US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,704,094.000	
		US T N/B 1.125 02/15/31	9,690,000.000	8,017,339.400	
		US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,862,662.500	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,005,082.030	
		US T N/B 1.125 02/29/28	4,690,000.000	4,176,206.830	
		US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,080,160.140	
		US T N/B 1.125 08/15/40	3,060,000.000	1,909,332.400	
		US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,278,247.460	
		US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,134,570.870	
		US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,117,756.450	
		US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,545,773.410	
		US T N/B 1.25 05/15/50	8,380,000.000	4,361,200.790	
		US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,682,497.660	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,294,001.740	
		US T N/B 1.25 08/15/31	8,960,000.000	7,347,899.950	
		US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,393,780.090	
		US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,335,474.620	
		US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,583,054.680	
		US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	724,168.010	
		US T N/B 1.375 08/15/50	6,870,000.000	3,696,784.550	
		US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,605,750.000	
		US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,172,857.600	
		US T N/B 1.375 11/15/31	9,190,000.000	7,561,287.890	
		US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,802,346.870	
		US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,060,308.570	
		US T N/B 1.5 01/31/27	5,740,000.000	5,314,208.560	
		US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,392,349.590	
		US T N/B 1.5 02/15/30	4,830,000.000	4,178,421.690	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,030,000.000	6,568,381.650	
		US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,448,730.450	

		US T N/B 1.625 02/15/26	6,090,000.000	5,763,495.110	
		US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,871,311.310	
		US T N/B 1.625 05/15/31	8,040,000.000	6,833,528.920	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,360,000.000	2,970,843.750	
		US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,450,521.470	
		US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,250,808.180	
		US T N/B 1.625 11/15/50	4,480,000.000	2,579,499.990	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,687,683.600	
		US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	4,038,486.340	
		US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,865,625.000	
		US T N/B 1.75 08/15/41	5,310,000.000	3,612,044.550	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,850,000.000	2,526,591.800	
		US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,932,256.710	
		US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,972,231.830	
		US T N/B 1.875 02/15/32	8,280,000.000	7,053,039.860	
		US T N/B 1.875 02/15/41	3,700,000.000	2,603,441.380	
		US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,549,507.000	
		US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,375,138.480	
		US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,607,500.000	
		US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,725,931.250	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,500,000.000	2,360,742.200	
		US T N/B 1.875 11/15/51	5,370,000.000	3,285,558.970	
		US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,980,075.000	
		US T N/B 2.0 02/15/50	4,420,000.000	2,817,663.650	
		US T N/B 2.0 08/15/25	3,550,000.000	3,414,725.580	
		US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,673,917.170	
		US T N/B 2.0 11/15/26	3,830,000.000	3,611,869.540	
		US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,009,531.250	
		US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,822,782.230	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,250,000.000	2,144,355.470	
		US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,578,227.710	
		US T N/B 2.25 02/15/52	5,000,000.000	3,357,519.530	
		US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,160,781.240	
		US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,297,043.740	
		US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,984,689.060	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,270,000.000	1,573,305.080	
		US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,807,275.770	
		US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,925,799.960	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,062,878.720	
		US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,712,294.510	
		US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,693,515.630	
		US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,976,151.560	
		US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,195,175.390	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,570,000.000	3,290,117.550	
		US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	3,846,281.990	
		US T N/B 2.375 11/15/49	3,490,000.000	2,431,207.590	
		US T N/B 2.5 01/31/25	500,000.000	488,423.420	
		US T N/B 2.5 02/15/45	1,810,000.000	1,340,283.770	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,296,006.430	

		US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,196,993.730	
		US T N/B 2.5 03/31/27	4,000,000.000	3,811,093.750	
		US T N/B 2.5 05/15/46	1,730,000.000	1,263,474.400	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,378,656.620	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,522,276.150	
		US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,747,347.660	
		US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,925,527.340	
		US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,685,118.160	
		US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,858,038.070	
		US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,903,789.070	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,320,359.740	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,917,660.940	
		US T N/B 2.75 04/30/27	6,000,000.000	5,753,203.130	
		US T N/B 2.75 05/15/25	2,200,000.000	2,146,546.860	
		US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,098,841.790	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,014,020.300	
		US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,653,695.680	
		US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	7,107,450.000	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	985,630.460	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,692,273.810	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,779,960.930	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,233,130.000	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,706,000.970	
		US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,955,507.820	
		US T N/B 2.875 04/30/29	3,800,000.000	3,594,636.700	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,860,000.000	4,638,262.500	
		US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,388,390.620	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,843,181.620	
		US T N/B 2.875 05/15/49	4,600,000.000	3,556,195.320	
		US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,483,446.470	
		US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,533,448.430	
		US T N/B 2.875 06/15/25	2,420,000.000	2,363,706.630	
		US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,146,074.210	
		US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,790,485.520	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,395,672.640	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	843,623.410	
		US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,268,715.620	
		US T N/B 3.0 02/15/47	2,360,000.000	1,881,823.420	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,103,696.280	
		US T N/B 3.0 02/15/49	4,610,000.000	3,651,264.050	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	896,210.150	
		US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	1,041,498.630	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,290,178.120	
		US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,129,375.000	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	3,021,062.100	
		US T N/B 3.0 08/15/52	3,740,000.000	2,967,164.060	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,708,095.690	
		US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,214,358.380	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,960,000.000	1,588,786.690	

		US T N/B 3.0 11/15/45	460,000.000	370,057.410	
		US T N/B 3.125 02/15/42	360,000.000	305,852.340	
		US T N/B 3.125 02/15/43	1,740,000.000	1,458,745.310	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,297,329.860	
		US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,966,855.280	
		US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,733,924.410	
		US T N/B 3.125 08/31/27	2,940,000.000	2,846,517.160	
		US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,969,321.070	
		US T N/B 3.125 11/15/28	5,480,000.000	5,266,900.760	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	868,932.410	
		US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,232,939.060	
		US T N/B 3.25 06/30/27	4,200,000.000	4,090,160.170	
		US T N/B 3.25 06/30/29	2,300,000.000	2,213,660.160	
		US T N/B 3.375 05/15/33	5,900,000.000	5,595,781.250	
		US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,235,916.590	
		US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,553,003.910	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,950,000.000	3,352,408.170	
		US T N/B 3.5 01/31/28	3,380,000.000	3,312,400.000	
		US T N/B 3.5 01/31/30	2,500,000.000	2,428,613.270	
		US T N/B 3.5 02/15/33	7,900,000.000	7,575,359.360	
		US T N/B 3.5 02/15/39	1,000,000.000	928,476.550	
		US T N/B 3.5 04/30/28	3,100,000.000	3,036,667.960	
		US T N/B 3.5 04/30/30	3,000,000.000	2,911,699.230	
		US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,952,890.640	
		US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,465,312.680	
		US T N/B 3.625 02/15/53	3,800,000.000	3,409,015.630	
		US T N/B 3.625 03/31/28	3,800,000.000	3,741,441.380	
		US T N/B 3.625 03/31/30	3,300,000.000	3,225,621.100	
		US T N/B 3.625 05/15/26	3,500,000.000	3,452,421.870	
		US T N/B 3.625 05/15/53	3,510,000.000	3,152,144.540	
		US T N/B 3.625 05/31/28	2,500,000.000	2,461,669.920	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,325,813.650	
		US T N/B 3.75 04/15/26	6,000,000.000	5,934,257.820	
		US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,444,082.040	
		US T N/B 3.75 06/30/30	5,700,000.000	5,608,710.960	
		US T N/B 3.75 08/15/41	1,220,000.000	1,138,436.310	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,338,551.950	
		US T N/B 3.875 01/15/26	4,300,000.000	4,262,039.080	
		US T N/B 3.875 02/15/43	3,500,000.000	3,275,234.370	
		US T N/B 3.875 03/31/25	1,050,000.000	1,040,053.700	
		US T N/B 3.875 05/15/43	800,000.000	748,125.000	
		US T N/B 3.875 08/15/33	8,000,000.000	7,893,750.000	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,233,083.770	
		US T N/B 3.875 09/30/29	2,150,000.000	2,132,699.200	
		US T N/B 3.875 11/30/27	3,000,000.000	2,980,664.070	
		US T N/B 3.875 11/30/29	2,800,000.000	2,776,703.120	
		US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,572,867.170	
		US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,776,539.050	
		US T N/B 4.0 02/15/26	4,000,000.000	3,974,687.520	

	US T N/B 4.0 02/28/30	3,000,000.000	2,994,140.640	
	US T N/B 4.0 02/29/28	3,200,000.000	3,196,124.990	
	US T N/B 4.0 06/30/28	2,000,000.000	1,999,414.060	
	US T N/B 4.0 07/31/30	2,500,000.000	2,495,312.500	
	US T N/B 4.0 10/31/29	2,700,000.000	2,695,359.370	
	US T N/B 4.0 11/15/42	3,120,000.000	2,977,589.050	
	US T N/B 4.0 11/15/52	4,860,000.000	4,662,562.500	
	US T N/B 4.0 12/15/25	4,140,000.000	4,111,699.200	
	US T N/B 4.125 01/31/25	1,800,000.000	1,788,278.590	
	US T N/B 4.125 06/15/26	4,700,000.000	4,689,259.740	
	US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,512,646.470	
	US T N/B 4.125 08/15/53	1,000,000.000	982,343.750	
	US T N/B 4.125 09/30/27	3,220,000.000	3,227,483.980	
	US T N/B 4.125 10/31/27	940,000.000	942,019.530	
	US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,644,234.320	
	US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	959,537.090	
	US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,987,187.510	
	US T N/B 4.25 11/15/40	1,300,000.000	1,299,314.440	
	US T N/B 4.25 12/31/24	4,500,000.000	4,475,073.150	
	US T N/B 4.375 02/15/38	200,000.000	206,371.090	
	US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,232,002.130	
	US T N/B 4.375 05/15/41	1,630,000.000	1,648,687.680	
	US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	4,016,953.120	
	US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	2,002,656.240	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,021,386.720	
	US T N/B 4.375 12/15/26	800,000.000	805,375.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	500,000.000	525,371.080	
	US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	625,992.170	
	US T N/B 4.5 07/15/26	1,600,000.000	1,610,843.740	
	US T N/B 4.5 08/15/39	1,480,000.000	1,535,760.140	
	US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,576,345.100	
	US T N/B 4.625 02/15/40	1,690,000.000	1,774,500.000	
	US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,654,318.160	
	US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,539,238.290	
	US T N/B 4.625 10/15/26	3,400,000.000	3,440,109.380	
	US T N/B 4.625 11/15/26	600,000.000	607,570.310	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,304,784.950	
	US T N/B 5.0 05/15/37	755,000.000	830,647.450	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,423,880.850	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,160,000.000	1,262,134.380	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,478,374.990	
	US T N/B 6.125 11/15/27	2,200,000.000	2,362,250.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	852,333.270	
アメリカ・ドル　小計		879,620,000.000 (128,116,653,000)	786,712,353.830 (114,584,654,333)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,621,756.500	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,162,800.270	

		UK TREASURY 0.25 01/31/25	1,800,000.000	1,721,257.200	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,735,569.020	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,930,000.000	1,756,110.860	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,390,000.000	1,118,961.120	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,880,000.000	1,608,340.000	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	583,891.140	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,060,000.000	1,008,113.000	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,650,000.000	1,143,945.000	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,190,000.000	494,756.780	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,350,000.000	688,650.920	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,100,000.000	1,607,602.080	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,430,000.000	1,226,906.240	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,470,000.000	2,003,733.160	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	2,110,000.000	1,390,473.120	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	283,779.640	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	1,011,120.000	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,530,000.000	772,038.000	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,750,000.000	1,095,325.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,900,000.000	1,796,678.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,300,000.000	753,608.960	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,210,000.000	638,396.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	940,874.100	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	686,181.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	399,791.410	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	830,000.000	500,988.000	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,130,000.000	620,898.840	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,427,706.000	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,072,734.520	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	823,493.990	

	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,640,000.000	1,396,132.000	
	UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,100,000.000	2,012,115.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,550,000.000	1,363,225.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,480,000.000	1,256,964.000	
	UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,482,193.800	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,500,000.000	1,435,644.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	871,060.000	
	UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,607,940.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	846,540.000	
	UK TREASURY 4.0 10/22/63	820,000.000	769,816.000	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,190,000.000	2,206,950.600	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,300,000.000	1,333,163.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,820,000.000	1,889,979.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,063,447.120	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,310,000.000	1,335,417.130	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,067,860.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,253,760.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,317,000.000	1,286,917.330	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,112,000.000	1,087,674.540	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,350,000.000	1,392,050.070	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,262,160.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,465,000.000	1,499,134.500	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	200,000.000	212,335.920	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,495,000.000	1,593,931.620	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,380,000.000	1,467,492.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,485,000.000	1,494,411.930	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	880,000.000	971,242.090	
イギリス・ポンド　小計		82,614,000.000 (15,338,941,380)	69,156,036.520 (12,840,201,301)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,430,000.000	1,335,425.520	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,812,394.710	

	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,403,649.820	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,200,000.000	966,176.400	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,420,000.000	1,713,316.440	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,936,410.000	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	960,000.000	674,698.560	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,660,000.000	1,573,520.640	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,360,000.000	2,204,964.520	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,589,042.440	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,410,000.000	1,581,516.630	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,300,068.600	
イスラエル・シュケル　小計		21,220,000.000 (825,742,348)	19,091,184.280 (742,902,890)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,366,321.300	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	2,615,000.000	2,399,325.270	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,970,000.000	1,571,960.730	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,373,149.000	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,709,793.680	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,010,000.000	1,690,302.260	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	2,520,000.000	1,437,352.040	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,530,960.040	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,780,000.000	1,672,789.020	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,660,000.000	1,529,672.010	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	767,375.760	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	566,605.020	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,379,360.480	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	900,000.000	858,960.970	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,318,733.470	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	857,483.160	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,670,000.000	1,520,069.210	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,100,000.000	1,089,839.120	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,400,000.000	1,362,001.900	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	720,206.030	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,200,000.000	1,131,965.830	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	788,797.300	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,800,000.000	1,742,983.480	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,615,915.350	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,710,481.080	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,140,000.000	1,175,162.380	
オーストラリア・ドル　小計		39,315,000.000	34,887,565.890	

		(3,841,075,500)	(3,408,515,187)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	35,000,000.000	34,882,168.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	19,976,339.790	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,489,488.560	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	40,500,000.000	40,548,316.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,813,117.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	39,500,000.000	39,508,180.450	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	7,000,000.000	7,016,231.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	25,000,000.000	24,987,128.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,026,590.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,191,256.070	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,484,212.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	14,300,000.000	14,304,328.610	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	7,000,000.000	7,050,022.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	15,500,000.000	15,594,923.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	7,000,000.000	7,053,967.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	64,600,000.000	65,120,495.120	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	55,600,000.000	56,124,018.880	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	21,000,000.000	21,213,124.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,500,000.000	15,676,479.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,295,328.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,138,926.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	24,000,000.000	24,358,454.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,198,924.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,149,602.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	31,300,000.000	31,825,148.270	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	23,500,000.000	23,852,025.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	11,200,000.000	11,504,246.880	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	15,100,000.000	15,429,003.330	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	28,100,000.000	28,722,035.650	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	49,000,000.000	50,277,679.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	16,500,000.000	17,014,903.950	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	45,000,000.000	45,757,138.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	9,500,000.000	10,020,446.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,276,351.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	5,500,000.000	5,920,590.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,896,713.240	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,176,989.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	15,820,000.000	17,096,110.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	16,100,000.000	17,719,439.430	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	12,450,000.000	14,058,674.460	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,234,995.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,600,000.000	8,876,059.760	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	14,500,000.000	17,141,072.050	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	5,800,000.000	6,878,419.520	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	10,300,000.000	12,500,838.080	
オフショア・人民元　小計		917,520,000.000 (18,604,277,784)	939,380,507.100 (19,047,536,728)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,308,760.870	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,179,738.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,160,004.790	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	507,255.690	
	CANADA 1.0 09/01/26	2,070,000.000	1,934,278.740	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	675,826.430	

		CANADA 1.25 03/01/27	910,000.000	848,080.300	
		CANADA 1.25 06/01/30	2,350,000.000	2,077,437.120	
		CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,062,381.210	
		CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,615,007.000	
		CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,182,809.870	
		CANADA 1.5 12/01/31	2,420,000.000	2,122,341.080	
		CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,581,033.000	
		CANADA 2.0 06/01/28	930,000.000	880,197.190	
		CANADA 2.0 06/01/32	1,590,000.000	1,442,288.590	
		CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,694,796.840	
		CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,285,051.500	
		CANADA 2.25 06/01/29	530,000.000	504,201.500	
		CANADA 2.25 12/01/29	700,000.000	663,717.670	
		CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,429,882.570	
		CANADA 2.75 06/01/33	1,180,000.000	1,130,734.120	
		CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,023,705.670	
		CANADA 2.75 12/01/48	960,000.000	884,586.760	
		CANADA 2.75 12/01/55	200,000.000	182,426.130	
		CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	355,948.160	
		CANADA 3.0 04/01/26	1,400,000.000	1,375,937.580	
		CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,630,010.220	
		CANADA 3.25 09/01/28	1,200,000.000	1,194,405.670	
		CANADA 3.25 12/01/33	2,100,000.000	2,096,318.700	
		CANADA 3.5 03/01/28	1,130,000.000	1,133,608.750	
		CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	395,837.680	
		CANADA 3.5 12/01/45	800,000.000	832,851.680	
		CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,149,941.370	
		CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	625,881.970	
		CANADA 5.0 06/01/37	530,000.000	626,960.740	
		CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	829,994.520	
		CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	730,790.790	
	カナダ・ドル　小計		48,900,000.000 (5,324,721,000)	45,355,030.470 (4,938,709,268)	
	シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	280,000.000	266,547.400	
		SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	487,203.000	
		SINGAPORE 1.625 07/01/31	840,000.000	773,220.000	
		SINGAPORE 1.875 03/01/50	840,000.000	689,640.000	
		SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	419,026.200	
		SINGAPORE 2.125 06/01/26	590,000.000	577,020.000	
		SINGAPORE 2.25 08/01/36	890,000.000	835,443.000	
		SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	768,768.000	
		SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	178,315.950	
		SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	339,082.000	
		SINGAPORE 2.75 03/01/46	460,000.000	449,420.000	
		SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	648,809.700	
		SINGAPORE 2.875 07/01/29	590,000.000	593,717.000	
		SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	201,000.000	
		SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	623,100.000	

	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	131,250.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	580,000.000	605,989.800	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	815,600.000	
シンガポール・ドル　小計		9,805,000.000 (1,073,157,250)	9,403,152.050 (1,029,174,992)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,242,210.960	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,184,153.860	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,960,000.000	3,658,249.090	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	8,210,000.000	7,889,312.290	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,600,000.000	2,488,764.000	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	4,064,491.300	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,877,815.840	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,990,000.000	4,532,121.300	
スウェーデン・クローナ　小計		37,040,000.000 (527,449,600)	35,937,118.640 (511,744,569)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,251,706.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,560,000.000	2,478,323.520	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,533,475.900	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,240,000.000	4,739,910.620	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,740,000.000	3,679,005.820	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,700,000.000	1,677,495.400	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,650,000.000	9,606,135.600	
デンマーク・クローネ　小計		32,820,000.000 (703,332,600)	30,966,052.860 (663,602,513)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	544,605.000	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	527,746.140	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	713,856.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	251,533.450	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	748,815.900	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	720,000.000	699,816.930	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	643,353.460	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	540,000.000	363,603.730	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	701,781.410	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	412,217.280	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	125,323.120	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	800,648.160	
ニュージーランド・ドル　小計		7,620,000.000 (692,124,600)	6,533,300.580 (593,419,692)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,520,760.250	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,510,000.000	3,975,903.250	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,426,321.330	

	NORWAY 1.75 02/17/27	5,100,000.000	4,848,723.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,102,434.550	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,677,727.600	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,962,815.400	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,030,000.000	1,836,374.540	
	NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,793,251.000	
	NORWAY 3.5 10/06/42	2,200,000.000	2,257,890.800	
ノルウェー・クローネ　小計		32,520,000.000 (457,556,400)	30,402,201.720 (427,758,978)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,660,989.400	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,170,000.000	3,960,707.700	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,720,000.000	3,750,658.320	
	POLAND 1.75 04/25/32	5,170,000.000	4,037,532.180	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,290,000.000	3,109,043.420	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,187,436.800	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,189,718.640	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,792,158.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,552,830.570	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,529,017.100	
	POLAND 5.75 04/25/29	2,190,000.000	2,271,157.020	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,752,577.960	
ポーランド・ズロチ　小計		37,880,000.000 (1,397,150,768)	34,793,827.110 (1,283,321,602)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	1,018,359.460	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	648,184.740	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,373,115.150	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,006,728.000	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,435,905.200	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,804,134.510	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,653,365.310	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	706,386.030	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,009,529.700	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,748,719.630	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,678,266.460	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,920,000.000	1,941,561.400	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,950,000.000	1,965,756.000	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,635,414.670	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	686,763.120	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,400,000.000	1,426,943.140	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,069,930.570	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	2,000,000.000	2,055,213.800	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,248,246.600	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,059,234.960	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	950,000.000	1,013,406.700	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	960,000.000	1,033,008.650	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	320,018.580	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,826,021.000	

	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,185,173.230	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,755,557.440	
マレーシア・リンギット　小計		37,560,000.000 (1,178,591,484)	38,304,944.050 (1,201,967,009)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,080,000.000	22,467,416.400	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	3,680,000.000	3,491,032.000	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,290,000.000	17,336,115.900	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	13,290,000.000	11,694,668.400	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	8,000,000.000	7,511,200.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,871,692.500	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	36,282,000.000	33,469,075.030	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	28,146,000.000	26,617,953.660	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,148,000.000	27,939,960.480	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	24,707,000.000	21,524,738.400	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	9,335,000.000	8,451,442.250	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,561,000.000	17,334,175.760	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	24,159,000.000	23,546,086.170	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,795,142.120	
メキシコ・ペソ　小計		262,805,000.000 (2,254,525,254)	242,050,699.070 (2,076,480,332)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,180,000.000	1,010,664.100	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,410,000.000	1,170,261.930	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	620,000.000	550,220.410	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	510,000.000	309,519.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	280,000.000	199,696.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,373,981.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,170,000.000	1,096,719.390	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	410,000.000	185,583.220	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	935,000.000	870,930.990	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	345,341.160	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,190,000.000	1,132,091.030	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	134,022.660	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	600,000.000	521,333.400	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	940,000.000	915,770.560	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	550,857.840	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	112,214.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	590,000.000	466,250.450	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	453,393.810	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	289,129.230	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	870,000.000	837,859.590	

		AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,100,000.000	1,111,584.100	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	557,569.420	
		AUSTRIA 3.15 10/20/53	300,000.000	303,493.800	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	358,728.280	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,136,539.870	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,210,000.000	1,264,499.610	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	690,462.960	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	1,080,000.000	985,210.010	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	848,698.240	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	1,300,000.000	1,113,450.000	
		BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	864,675.000	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	930,000.000	604,890.600	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	369,593.400	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	1,380,000.000	1,338,544.800	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,260,000.000	1,190,989.800	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	873,730.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	1,200,000.000	1,105,198.800	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,360,000.000	1,309,224.400	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,570,000.000	1,399,075.670	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	410,000.000	361,912.740	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	1,390,000.000	900,642.160	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	780,000.000	645,279.180	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	672,768.400	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	880,000.000	636,655.360	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	527,216.900	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	340,425.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	309,209.100	
		BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	306,419.840	
		BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,221,897.600	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	480,000.000	486,845.280	
		BELGIUM 3.3 06/22/54	270,000.000	267,653.700	
		BELGIUM 3.45 06/22/43	100,000.000	103,134.400	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	691,542.400	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	930,000.000	1,020,772.650	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,464,151.040	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,111,596.250	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,570,000.000	1,881,305.880	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,793,225.600	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,510,000.000	3,325,023.000	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,532,605.770	
		BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,610,000.000	1,497,206.620	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,760,000.000	2,589,956.400	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,650,000.000	2,530,299.500	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,292,301.000	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,280,000.000	2,207,724.000	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,300,000.000	1,262,157.000	
		BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,100,000.000	2,101,848.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,720,000.000	1,515,130.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,340,000.000	2,019,092.400	

		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,500,000.000	2,108,362.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,360,000.000	1,049,090.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,880,000.000	1,409,097.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	3,730,000.000	3,252,075.100	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	777,201.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,790,000.000	1,527,514.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	683,422.080	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,678,863.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,010,000.000	541,733.700	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,540,000.000	1,290,878.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,490,788.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,560,000.000	2,313,699.840	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,994,199.200	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,430,000.000	1,303,394.950	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,570,000.000	2,361,624.400	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,847,066.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,860,000.000	3,702,589.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	1,984,044.400	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,610,000.000	2,459,653.560	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	2,590,000.000	2,439,049.620	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	2,290,000.000	2,038,278.620	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,660,000.000	1,376,306.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,353,764.600	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,820,000.000	2,219,813.760	
		DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,330,000.000	2,248,217.000	
		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,850,000.000	1,609,037.500	
		DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,000,000.000	1,995,760.000	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	3,050,000.000	3,081,201.500	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	700,000.000	707,035.000	
		DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	300,000.000	304,767.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,170,000.000	2,183,410.600	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	2,264,505.600	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,482,817.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,030,000.000	2,393,976.970	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,130,000.000	1,391,640.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,311,570.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,020,000.000	2,484,377.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	2,108,858.500	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,620,000.000	3,184,452.800	

		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,477,313.200	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,180,000.000	1,450,137.400	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	650,000.000	740,057.500	
		FINLAND 0.0 09/15/30	510,000.000	430,236.000	
		FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	200,207.680	
		FINLAND 0.125 04/15/52	440,000.000	207,508.220	
		FINLAND 0.125 09/15/31	500,000.000	413,438.000	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	187,103.360	
		FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	438,714.880	
		FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	241,891.280	
		FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	372,169.200	
		FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	592,986.550	
		FINLAND 0.5 09/15/29	800,000.000	715,590.550	
		FINLAND 0.75 04/15/31	600,000.000	527,084.280	
		FINLAND 0.875 09/15/25	810,000.000	785,196.180	
		FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	409,328.430	
		FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	202,463.600	
		FINLAND 1.375 04/15/47	380,000.000	279,839.980	
		FINLAND 1.5 09/15/32	550,000.000	499,725.320	
		FINLAND 2.625 07/04/42	330,000.000	312,844.950	
		FINLAND 2.75 04/15/38	270,000.000	262,913.310	
		FINLAND 2.75 07/04/28	390,000.000	394,233.450	
		FINLAND 4.0 07/04/25	320,000.000	325,106.880	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,190,000.000	1,149,290.690	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,530,000.000	3,339,676.520	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,500,000.000	3,238,956.000	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,790,000.000	2,246,508.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,590,000.000	3,109,923.660	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,780,000.000	4,026,748.480	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,670,000.000	3,003,494.970	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,220,000.000	3,018,170.400	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,430,000.000	3,317,118.700	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	4,960,000.000	4,722,242.400	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,490,000.000	3,149,184.050	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,950,000.000	1,310,749.050	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	311,730.050	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,390,000.000	842,662.480	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,780,000.000	3,528,317.200	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,360,944.910	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,470,000.000	1,913,489.860	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	2,850,000.000	1,537,677.600	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,600,000.000	4,242,432.800	
		FRANCE OAT 03/25/25	2,070,000.000	1,995,614.550	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,560,000.000	3,389,116.440	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,653,603.590	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	3,075,644.200	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,980,000.000	2,466,844.000	

		FRANCE OAT 1.25 05/25/38	900,000.000	714,510.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,780,000.000	5,380,434.380	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,470,000.000	2,435,881.010	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	940,000.000	644,503.480	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,450,000.000	2,076,201.050	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,563,151.200	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	3,350,000.000	3,178,845.150	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,650,000.000	4,649,897.290	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,200,000.000	1,086,672.800	
		FRANCE OAT 2.5 09/24/26	3,620,000.000	3,611,068.540	
		FRANCE OAT 2.75 02/25/29	1,900,000.000	1,922,959.030	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,790,000.000	2,816,055.810	
		FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,000,000.000	3,074,654.700	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,540,000.000	2,578,976.300	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,923,142.300	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,752,985.260	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,690,569.040	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,040,000.000	2,285,673.120	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,540,000.000	3,023,410.260	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,756,115.060	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,100,000.000	3,553,353.300	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,610,000.000	3,234,270.240	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,289,228.480	
		IRISH 0.0 10/18/31	670,000.000	554,453.470	
		IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	390,625.400	
		IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	301,897.860	
		IRISH 0.35 10/18/32	600,000.000	498,421.200	
		IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	288,185.600	
		IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	170,579.000	
		IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	667,932.700	
		IRISH 1.0 05/15/26	1,000,000.000	965,128.000	
		IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	682,781.410	
		IRISH 1.3 05/15/33	190,000.000	170,131.700	
		IRISH 1.35 03/18/31	660,000.000	612,951.900	
		IRISH 1.5 05/15/50	570,000.000	417,120.300	
		IRISH 1.7 05/15/37	680,000.000	595,442.000	
		IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	707,879.760	
		IRISH 2.4 05/15/30	860,000.000	859,160.640	
		IRISH 3.0 10/18/43	210,000.000	212,550.030	
		IRISH 5.4 03/13/25	590,000.000	605,067.420	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,889,912.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,850,000.000	1,714,765.000	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,298,086.000	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,800,000.000	1,566,990.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,528,936.500	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	979,330.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,920,000.000	1,552,682.880	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,604,493.000	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,766,225.210	

		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,480,000.000	1,024,012.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,080,000.000	874,908.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,156,410.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,559,040.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,399,567.500	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,035,210.000	
		ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,318,234.400	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,630,000.000	1,552,685.840	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,642,632.020	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	776,424.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,880,000.000	1,836,970.560	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,110,000.000	688,533.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,560,000.000	1,523,613.000	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,850,000.000	2,759,085.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,990,000.000	1,722,774.840	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,140,000.000	1,904,728.400	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,120,000.000	674,758.560	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	817,880.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,216,192.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,540,000.000	1,477,140.280	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,628,143.330	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,644,389.600	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,790,000.000	1,751,396.750	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	216,540.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	334,458.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,547,706.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,127,848.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,195,034.260	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,200,000.000	863,280.000	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,534,932.450	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,224,492.000	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,720,000.000	1,694,372.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,070,000.000	831,604.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	400,000.000	287,000.000	
		ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,171,800.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,907,994.650	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,325,440.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,210,000.000	2,180,488.220	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,060,000.000	928,618.300	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	545,940.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,182,582.720	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	2,120,000.000	2,015,528.520	
		ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,162,420.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,048,750.570	
		ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,321,135.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,189,421.500	
		ITALY BTPS 3.7 06/15/30	600,000.000	609,600.000	
		ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,525,350.450	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,230,000.000	1,147,639.200	

		ITALY BTPS 3.85 09/15/26	800,000.000	816,960.000	
		ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,745,050.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,470,000.000	1,473,087.000	
		ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,172,412.000	
		ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,100,000.000	1,134,540.000	
		ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,600,000.000	1,687,680.000	
		ITALY BTPS 4.45 09/01/43	800,000.000	815,760.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,173,722.000	
		ITALY BTPS 4.5 10/01/53	670,000.000	681,122.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,180,000.000	2,326,908.020	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,560,000.000	1,656,833.880	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	360,000.000	366,464.160	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,360,000.000	2,598,360.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,890,000.000	2,066,337.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,650,000.000	1,804,440.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,913,768.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,660,000.000	3,076,822.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,260,000.000	2,631,092.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,257,230.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,250,000.000	1,392,250.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/26	2,180,000.000	2,069,262.750	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,098,658.100	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,310,000.000	1,165,679.920	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	650,000.000	448,361.740	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,430,000.000	702,380.250	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	600,699.260	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,591,083.100	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,360,000.000	1,214,021.680	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,210,000.000	872,327.910	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,820,000.000	1,733,095.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/32	800,000.000	681,230.480	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,460,000.000	1,381,341.760	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,379,565.720	
		NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	572,939.400	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	910,000.000	912,088.450	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/33	350,000.000	349,580.000	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,810,000.000	1,839,977.220	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,320,000.000	1,519,101.770	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,320,000.000	1,518,000.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	940,000.000	1,054,492.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	1,330,000.000	1,285,671.100	
		SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,547,313.760	
		SPAIN 0.0 01/31/27	1,810,000.000	1,665,290.500	
		SPAIN 0.0 01/31/28	1,680,000.000	1,507,128.000	

		SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	833,611.380	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,880,000.000	1,531,260.000	
		SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,558,818.000	
		SPAIN 0.5 10/31/31	2,140,000.000	1,775,677.840	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,630,000.000	1,438,519.010	
		SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,538,820.750	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,550,000.000	1,449,715.000	
		SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,523,625.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	1,100,000.000	793,087.900	
		SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	350,298.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,790,000.000	969,635.840	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,810,000.000	1,264,194.500	
		SPAIN 1.25 10/31/30	2,450,000.000	2,204,265.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	2,130,000.000	2,047,710.870	
		SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,053,390.710	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,670,000.000	1,575,561.500	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,500,000.000	1,403,251.500	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,774,724.580	
		SPAIN 1.45 10/31/71	410,000.000	197,808.460	
		SPAIN 1.5 04/30/27	1,510,000.000	1,451,034.500	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,598,166.100	
		SPAIN 1.85 07/30/35	1,390,000.000	1,198,499.700	
		SPAIN 1.9 10/31/52	1,270,000.000	850,013.540	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,730,000.000	1,696,062.590	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,673,596.950	
		SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,786,647.730	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,070,000.000	1,000,450.000	
		SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,652,416.040	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,610,000.000	1,343,715.660	
		SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,797,660.000	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,230,000.000	1,078,830.540	
		SPAIN 3.15 04/30/33	1,570,000.000	1,573,403.760	
		SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	713,818.760	
		SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,012,393.760	
		SPAIN 3.5 05/31/29	500,000.000	516,932.500	
		SPAIN 3.55 10/31/33	1,820,000.000	1,875,692.000	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,660,000.000	1,802,301.840	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,940,305.660	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,880,000.000	2,145,824.480	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,210,825.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	2,060,000.000	2,276,712.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,465,896.850	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,965,000.000	2,365,598.650	
		SPAIN 5.9 07/30/26	2,330,000.000	2,503,161.160	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,255,728.720	
	ユーロ　小計		530,550,000.000 (84,787,195,500)	494,457,151.660 (79,019,197,407)	
国債証券　合計			265,122,494,467.500 (265,122,494,468)	242,369,186,801 (242,369,186,801)	

合計		242,369,186,801 (242,369,186,801)	

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券	254銘柄	46.53	47.28
イギリス・ポンド	国債証券	58銘柄	5.21	5.30
イスラエル・シュケル	国債証券	12銘柄	0.30	0.31
オーストラリア・ドル	国債証券	26銘柄	1.38	1.41
オフショア・人民元	国債証券	45銘柄	7.74	7.86
カナダ・ドル	国債証券	37銘柄	2.01	2.04
シンガポール・ドル	国債証券	18銘柄	0.42	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.27	0.27
ニュージーランド・ドル	国債証券	12銘柄	0.24	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.17	0.18
ポーランド・ズロチ	国債証券	12銘柄	0.52	0.53
マレーシア・リンギット	国債証券	26銘柄	0.49	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.84	0.86
ユーロ	国債証券	342銘柄	32.09	32.60

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,958,800,883
コール・ローン	355,190,866
国債証券	94,709,525,097
未収利息	1,043,997,419
前払費用	346,823,656
流動資産合計	98,414,337,921
資産合計	98,414,337,921
負債の部	
流動負債	
未払金	979,537,032
未払解約金	4,591,000
流動負債合計	984,128,032
負債合計	984,128,032
純資産の部	
元本等	
元本	43,108,629,278
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	54,321,580,611
元本等合計	97,430,209,889
純資産合計	97,430,209,889
負債純資産合計	98,414,337,921

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	64,251,853,316円
同期中追加設定元本額	59,289,656,733円
同期中一部解約元本額	80,432,880,771円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国債券インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	84,978,240円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,138,545,187円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	190,962,852円
たわらノーロード　バランス（標準型）	593,695,880円
たわらノーロード　バランス（積極型）	269,849,763円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	479,249円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	4,873,130円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	67,873,716円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,090,952円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,769,887円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	66,803,835円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	271,810,079円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	409,557,576円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	794,325,757円
投資のソムリエ	13,214,442,947円
クルーズコントロール	339,862,214円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,271,156,358円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	308,073,145円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,430,371,755円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,762,496,820円
ワールドアセットバランス（基本コース）	365,283,783円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	790,241,150円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	64,820,223円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	32,817,248円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	12,230,676円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	243,947,771円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	897,164,068円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	226,950,242円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	94,125,468円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	35,579,539円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	21,721,137円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	5,181,361円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	2,110,115円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	20,715,333円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	9,091,771,409円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	413,316,399円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	523,182,615円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド２（適格機関投資家限定）	140,152,539円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	5,634,922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）	107,045,267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）	65,487,134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）	2,716,131,537円
計	43,108,629,278円
２．　受益権の総数	43,108,629,278口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

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

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年4月19日から2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2601円 (22,601円)

附属明細表
第１　有価証券明細表
（１）株式
該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	3,000,000.000	2,659,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	5,000,000.000	4,181,370.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	8,000,000.000	6,691,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	8,000,000.000	7,807,272.000	

ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	8,000,000.000	7,748,112.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	3,000,000.000	2,721,330.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	4,000,000.000	2,385,000.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	6,000,000.000	5,587,140.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	5,000,000.000	3,502,465.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	5,000,000.000	4,021,360.000	
BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	8,685,156.240	
BRAZIL 3.75 09/12/31	15,000,000.000	13,240,272.150	
BRAZIL 3.875 06/12/30	7,000,000.000	6,358,092.510	
BRAZIL 4.5 05/30/29	6,000,000.000	5,761,042.140	
BRAZIL 4.75 01/14/50	7,000,000.000	5,266,876.370	
BRAZIL 6.0 10/20/33	8,000,000.000	7,935,790.160	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,679,858.840	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,674,823.560	
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	975,429.850	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	6,000,000.000	4,953,568.620	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	6,000,000.000	4,763,878.440	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	11,000,000.000	8,518,224.550	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	4,000,000.000	2,506,439.120	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	1,000,000.000	975,324.930	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	4,000,000.000	2,956,082.680	
COLOMBIA 7.5 02/02/34	8,000,000.000	8,164,237.200	
COLOMBIA 8.0 04/20/33	5,000,000.000	5,289,092.650	
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	6,000,000.000	5,452,501.680	
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	7,000,000.000	6,256,252.660	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	12,000,000.000	11,613,862.440	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	6,000,000.000	5,069,224.260	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	6,200,000.000	5,986,716.210	
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	10,000,000.000	9,261,192.900	
HUNGARY 2.125 09/22/31	13,000,000.000	10,295,493.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	3,834,900.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	8,000,000.000	7,945,048.000	
HUNGARY 5.375 03/25/24	3,380,000.000	3,378,894.740	
HUNGARY 6.125 05/22/28	6,000,000.000	6,192,000.000	
HUNGARY 6.25 09/22/32	9,000,000.000	9,445,500.000	

		INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,627,319.070	
		INDONESIA 3.05 03/12/51	4,000,000.000	2,872,780.880	
		INDONESIA 3.4 09/18/29	200,000.000	187,144.390	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	1,200,000.000	1,145,723.010	
		INDONESIA 3.85 10/15/30	9,400,000.000	8,883,153.970	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	2,200,000.000	2,179,513.420	
		INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	6,016,649.520	
		INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,582,476.460	
		INDONESIA 4.75 01/08/26	1,000,000.000	998,750.000	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	500,000.000	626,471.300	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	6,000,000.000	6,048,624.000	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	7,000,000.000	7,160,384.000	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	4,000,000.000	4,137,212.000	
		PANAMA 2.252 09/29/32	6,000,000.000	4,269,440.100	
		PANAMA 3.16 01/23/30	10,000,000.000	8,366,452.900	
		PANAMA 3.87 07/23/60	4,000,000.000	2,297,134.560	
		PANAMA 4.5 01/19/63	8,000,000.000	5,049,111.680	
		PANAMA 4.5 04/01/56	8,000,000.000	5,173,440.800	
		PANAMA 6.4 02/14/35	5,000,000.000	4,745,577.100	
		PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,018,508.350	
		PERU 2.392 01/23/26	3,000,000.000	2,844,000.000	
		PERU 2.78 12/01/60	4,000,000.000	2,371,984.240	
		PERU 2.783 01/23/31	5,000,000.000	4,292,499.800	
		PERU 3.0 01/15/34	11,000,000.000	9,055,750.000	
		PERU 3.55 03/10/51	7,000,000.000	5,092,579.520	
		PHILIPPINES 1.648 06/10/31	1,600,000.000	1,291,026.140	
		PHILIPPINES 2.65 12/10/45	6,000,000.000	4,038,298.320	
		PHILIPPINES 3.0 02/01/28	1,000,000.000	940,092.080	
		PHILIPPINES 3.2 07/06/46	6,000,000.000	4,356,373.740	
		PHILIPPINES 3.75 01/14/29	4,200,000.000	4,025,479.660	
		REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	4,200,000.000	3,621,250.540	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	6,200,000.000	5,270,228.340	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	4,000,000.000	3,262,290.040	
		REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	5,200,000.000	4,890,761.510	
		REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	4,000,000.000	2,570,096.680	
		REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	11,000,000.000	8,159,217.110	

		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	5,000,000.000	3,689,564.450	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	6,200,000.000	5,438,738.390	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	5,000,000.000	3,670,164.000	
		REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	5,000,000.000	4,360,545.000	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	8,000,000.000	7,866,211.680	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	2,000,000.000	2,133,000.000	
		ROMANIA 3.0 02/14/31	3,000,000.000	2,501,772.000	
		ROMANIA 4.0 02/14/51	13,000,000.000	9,069,450.000	
		ROMANIA 6.625 02/17/28	3,000,000.000	3,081,153.000	
		ROMANIA 7.125 01/17/33	14,000,000.000	14,804,776.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	11,000,000.000	8,861,545.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	6,000,000.000	5,785,230.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	12,200,000.000	11,108,917.400	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	2,000,000.000	1,327,568.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	3,400,000.000	2,439,806.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	12,000,000.000	11,786,760.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,931,168.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	4,000,000.000	3,299,360.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	6,000,000.000	6,006,240.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	5,000,000.000	4,983,930.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	3,000,000.000	2,675,049.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	5,000,000.000	4,661,790.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	7,000,000.000	7,291,109.000	
		SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	12,000,000.000	11,029,980.000	
		SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	1,400,000.000	1,373,454.600	
		SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	13,000,000.000	9,874,592.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	2,000,000.000	1,896,280.000	

	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	9,000,000.000	8,110,584.000	
	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,846,000.000	
	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	8,000,000.000	7,729,304.000	
	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	12,000,000.000	11,816,544.000	
	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	7,000,000.000	6,155,800.000	
	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	16,000,000.000	14,990,816.000	
	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	2,000,000.000	1,940,600.000	
	UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	5,000,000.000	3,454,745.000	
	UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	3,000,000.000	2,918,496.000	
	UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	1,000,000.000	1,036,825.000	
	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	8,000,000.000	6,720,344.960	
	UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	5,000,000.000	4,501,364.550	
	UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	7,000,000.000	5,859,715.050	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	4,000,000.000	2,600,317.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,639,209.520	
	UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,570,092.560	
	UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	8,000,000.000	6,485,903.440	
	UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	3,000,000.000	2,326,969.170	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	4,000,000.000	3,203,853.680	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	6,000,000.000	5,874,928.860	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	4,000,000.000	3,818,311.640	
	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	6,000,000.000	5,736,418.920	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	3,000,000.000	2,554,767.600	
	UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	5,000,000.000	4,996,258.750	
	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	5,000,000.000	5,208,662.600	

	アメリカ・ドル　小計	742,080,000.000 (108,083,952,000)	650,254,205.950 (94,709,525,097)	
国債証券　合計		108,083,952,000 (108,083,952,000)	94,709,525,097 (94,709,525,097)	
合計			94,709,525,097 (94,709,525,097)	

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券　127銘柄	97.21	100.00

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,346,442,632
投資証券	190,089,198,200
派生商品評価勘定	31,427,000
未収入金	166,374,837
未収配当金	1,753,995,455
差入委託証拠金	293,787,227
流動資産合計	195,681,225,351
資産合計	195,681,225,351
負債の部	
流動負債	
前受金	14,599,270
未払金	202,099,050
未払解約金	308,856,000
流動負債合計	525,554,320
負債合計	525,554,320
純資産の部	
元本等	
元本	82,686,701,762
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	112,468,969,269
元本等合計	195,155,671,031
純資産合計	195,155,671,031
負債純資産合計	195,681,225,351

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年1月12日 至　2024年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	85,187,544,308円
同期中追加設定元本額	52,377,528,215円
同期中一部解約元本額	54,878,370,761円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	206,608円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	826,637円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	2,132,076円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,867,240円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	2,556,710円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,830,637円
たわらノーロード　国内リート	5,779,316,164円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	1,030,290,178円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,031,312,275円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	44,708,338円
たわらノーロード　バランス（標準型）	947,060,093円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,119,289,174円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	338,493,762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）	890,475,712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）	595,544,270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）	683,676,862円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	3,834,317円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	78,328,681円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	8,568,881円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	20,944,702円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,351,111円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	472,721,663円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	4,117,615円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	143,513,616円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	235,440,168円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	453,743,560円
投資のソムリエ	6,261,256,526円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	602,537,467円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	168,765,080円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	678,148,430円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,258,533,877円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	46,208,736円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	22,978,722円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,793,727円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	99,152,449円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,403,846,679円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	129,770,255円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	47,570,480円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	25,369,162円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	15,229,494円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,696,192円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	56,079,857円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	69,423,108円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（隔月決算型）	3,183,268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）	199,039,010円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	86,229,198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）	199,624,459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）	52,555,443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）	119,806,100円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	182,820,385円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	69,524,532円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）２１－０３（適格機関投資家限定）	167,408,522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）	176,121,495円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	503,104,481円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	53,734,511円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０７（適格機関投資家限定）	88,456,676円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０８（適格機関投資家限定）	61,944,545円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	69,474,043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）	176,368,346円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０９（適格機関投資家限定）	61,798,967円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－１２（適格機関投資家限定）	89,119,425円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	154,237,015円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,092,073,429円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	195,919,180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）	68,303,470円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	435,860,545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）	328,874,163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）	2,685,782円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,226,633,727円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,485,723,749円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	33,918,287,989円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,487,789,805円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ専用＞	3,131,452,050円
計	82,686,701,762円
２．　受益権の総数	82,686,701,762口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年1月11日現在

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△4,376,125,713
合計	△4,376,125,713

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年6月7日から2024年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2024年1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	5,118,001,230	－	5,149,742,500	31,741,270
合計	5,118,001,230	－	5,149,742,500	31,741,270

（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1月11日現在

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3602円 (23,602円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	7,886	1,241,256,400	
	ＧＬＰ投資法人	61,879	8,823,945,400	
	ＫＤＸ不動産投資法人	52,717	8,476,893,600	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	18,572	2,321,500,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	3,195	862,969,500	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	9,140	1,112,338,000	
	いちごオフィスリート投資法人	15,010	1,248,832,000	
	いちごホテルリート投資法人	3,035	345,383,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,610	3,747,900,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	17,973	5,805,279,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	8,027	1,031,469,500	
	イオンリート投資法人	22,471	3,166,163,900	
	インヴィンシブル投資法人	88,695	5,233,005,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,724	443,900,800	
	オリックス不動産投資法人	36,500	6,139,300,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	13,527	1,504,202,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	9,008	2,819,504,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,991	552,004,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,868	531,640,800	
	ザイマックス・リート投資法人	2,971	352,954,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	61,323	4,286,477,700	
	ジャパンエクセレント投資法人	15,920	1,975,672,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	18,817	11,083,213,000	
	スターアジア不動産投資法人	28,232	1,668,511,200	
	スターツプロシード投資法人	3,175	634,365,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	8,686	885,972,000	
	トーセイ・リート投資法人	3,857	526,866,200	

	ヒューリックリート投資法人	17,139	2,572,563,900	
	フロンティア不動産投資法人	6,797	2,960,093,500	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	4,517	628,766,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	2,824	347,069,600	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	40,978	6,081,135,200	
	ラサールロジポート投資法人	23,417	3,571,092,500	
	阪急阪神リート投資法人	8,734	1,228,000,400	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,619	3,531,406,500	
	三菱地所物流リート投資法人	6,326	2,407,043,000	
	産業ファンド投資法人	27,951	3,960,656,700	
	森トラストリート投資法人	35,310	2,595,285,000	
	森ヒルズリート投資法人	21,541	3,037,281,000	
	星野リゾート・リート投資法人	3,380	1,902,940,000	
	積水ハウス・リート投資法人	55,047	4,282,656,600	
	大江戸温泉リート投資法人	2,801	192,428,700	
	大和ハウスリート投資法人	27,613	7,118,631,400	
	大和証券オフィス投資法人	3,795	2,546,445,000	
	大和証券リビング投資法人	26,976	2,818,992,000	
	投資法人みらい	25,140	1,116,216,000	
	東海道リート投資法人	2,726	345,384,200	
	東急リアル・エステート投資法人	12,282	2,124,786,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	6,325	3,813,975,000	
	日本ビルファンド投資法人	21,370	13,228,030,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	12,528	4,510,080,000	
	日本プロロジスリート投資法人	31,912	8,884,300,800	
	日本リート投資法人	5,950	2,037,875,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	11,734	3,344,190,000	
	日本都市ファンド投資法人	87,807	9,017,778,900	
	福岡リート投資法人	9,474	1,604,895,600	
	平和不動産リート投資法人	13,687	1,849,113,700	
	野村不動産マスターファンド投資法人	59,239	9,608,565,800	
投資証券　合計		1,157,748	190,089,198,200	
合計			190,089,198,200	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	291,345,566
コール・ローン	138,743,904
投資信託受益証券	8,654,558,251
投資証券	76,625,512,642
派生商品評価勘定	3
未収配当金	343,927,749
流動資産合計	86,054,088,115
資産合計	86,054,088,115
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	190,380
未払金	1,247,952
未払解約金	126,091,000
流動負債合計	127,529,332
負債合計	127,529,332
純資産の部	
元本等	
元本	44,985,698,714
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	40,940,860,069
元本等合計	85,926,558,783
純資産合計	85,926,558,783
負債純資産合計	86,054,088,115

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	41,342,647,392円
同期中追加設定元本額	51,126,172,202円
同期中一部解約元本額	47,483,120,880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＞	2,323,537,268円
たわらノーロード　先進国リート（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	21,330,884円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,391,032円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,821,536円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	35,518,263円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	47,105,546円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	42,759,959円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	30,255,467円
たわらノーロード　先進国リート	14,977,569,054円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,610,081,413円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	312,413,276円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,933,058,648円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	27,315,784円
たわらノーロード　バランス（標準型）	590,193,052円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,274,081,511円

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	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）	590,630,209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）	587,476,518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）	1,011,635,692円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	523,451円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	40,242,973円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	8,301,357円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	27,670,846円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	1,816,302,161円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	18,120,531円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	690,441,854円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	75,897,601円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	208,424,756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）	584,314,104円
投資のソムリエ	6,635,929,025円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	638,247,483円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	224,486,292円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	718,519,096円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,391,465,106円
ワールドアセットバランス（基本コース）	306,471,994円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	653,565,055円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	44,898,926円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	22,666,588円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	6,141,422円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	123,389,850円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	169,790,603円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	43,907,830円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	24,586,973円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	14,995,943円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,543,871円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	74,209,308円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	275,542,143円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	356,306,846円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	217,802円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	647,540円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	125,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	285,547円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	506,310円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	207,457,098円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	1,865,358円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	572,716円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	2,887,159円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	44,551,137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）	126,783,242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）	653,179,855円
計	44,985,698,714円
２．　受益権の総数	44,985,698,714口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	419,905,722
投資証券	6,589,090,694
合計	7,008,996,416

（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1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち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	86,001,940	－	86,192,320	△190,380
アメリカ・ドル	58,247,440	－	58,250,920	△3,480
香港・ドル	27,754,500	－	27,941,400	△186,900
買建	3,266,232	－	3,266,235	3
カナダ・ドル	3,266,232	－	3,266,235	3
合計	89,268,172	－	89,458,555	△190,377

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.9101円
（1万口当たり純資産額）	(19,101円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	340,400.000	216,154.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	291,800.000	99,212.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	66,281.000	
		PRIME US REIT	317,600.000	69,872.000	
	アメリカ・ドル　小計		1,861,500.000	451,519.000 (65,763,742)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	168,642.000	188,035.830	
		ABACUS STORAGE KING	224,215.000	247,757.570	
		ARENA REIT	157,934.000	568,562.400	
		BWP TRUST	202,343.000	718,317.650	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	338,978.000	583,042.160	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	224,107.000	726,106.680	
		CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	243,640.350	
		CHARTER HALL GROUP	202,814.000	2,342,501.700	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	281,949.000	1,031,933.340	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	222,343.000	798,211.370	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	157,053.000	455,453.700	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	618,825.000	247,530.000	
		DEXUS	460,735.000	3,520,015.400	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	93,159.000	256,187.250	
		GDI PROPERTY GROUP	222,442.000	144,587.300	
		GOODMAN GROUP	739,496.000	17,962,357.840	
		GPT GROUP	815,837.000	3,752,850.200	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	119,794.000	285,109.720	
		HEALTHCO REIT	202,023.000	281,822.080	
		HMC CAPITAL LTD	102,770.000	580,650.500	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	755,009.000	939,986.200	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85,857.000	242,116.740	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	159,608.000	723,024.240	
		MIRVAC GROUP	1,710,947.000	3,473,222.410	
		NATIONAL STORAGE REIT	532,588.000	1,198,323.000	
		REGION RE LTD	515,481.000	1,134,058.200	
		RURAL FUNDS GROUP	177,948.000	373,690.800	
		SCENTRE GROUP	2,216,201.000	6,559,954.960	
		STOCKLAND	1,017,680.000	4,528,676.000	

		VICINITY CENTRES	1,646,849.000	3,376,040.450	
		WAYPOINT REIT LTD	299,993.000	707,983.480	
	オーストラリア・ドル　小計		14,859,605.000	58,191,749.520 (5,685,333,927)	
	シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	292,995.000	392,613.300	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,044,316.000	1,007,764.940	
		CAPITALAND CHINA TRUST	497,080.000	447,372.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,157,109.000	4,271,075.820	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	1,516,960.000	4,429,523.200	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	291,800.000	306,390.000	
		EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	31,472.000	
		ESR LOGOS REIT	2,528,040.000	821,613.000	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	474,300.000	303,552.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	457,900.000	1,048,591.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,234,464.000	1,407,288.960	
		KEPPEL DC REIT	570,400.000	1,055,240.000	
		KEPPEL REIT	969,900.000	911,706.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	731,400.000	457,125.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	894,420.000	2,218,161.600	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,438,020.000	2,358,352.800	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	994,600.000	1,501,846.000	
		PARAGON REIT	530,600.000	448,357.000	
		PARKWAY LIFE REIT	166,600.000	609,756.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	242,300.000	167,187.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	621,200.000	319,918.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	956,790.000	1,195,987.500	
	シンガポール・ドル　小計		18,723,594.000	25,710,893.120 (2,814,057,252)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	129,840.000	183,074.400	
	ユーロ　小計		129,840.000	183,074.400 (29,257,120)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	674,000.000	3,228,460.000	
	香港・ドル　小計		674,000.000	3,228,460.000 (60,146,210)	
投資信託受益証券　合計			36,248,539	8,654,558,251 (8,654,558,251)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	41,188.000	713,788.040	

AGREE REALTY CORP	43,616.000	2,724,691.520	
ALEXANDER & BALDWIN INC	31,305.000	572,255.400	
ALEXANDER'S INC.	1,048.000	227,541.760	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	66,885.000	8,636,860.050	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	71,283.840	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	20,536.000	487,730.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT	135,850.000	4,912,336.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	113,680.000	3,436,546.400	
APARTMENT INCOME REIT CORP	63,688.000	2,243,728.240	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	60,749.000	475,664.670	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	90,294.000	1,486,239.240	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	28,991.000	358,908.580	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	19,790.520	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	60,760.000	11,162,219.600	
BOSTON PROPERTIES INC	61,645.000	4,442,755.150	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	54,212.370	
BRANDYWINE REALTY TRUST	73,547.000	408,921.320	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	128,135.000	2,940,698.250	
BROADSTONE NET LEASE INC	80,172.000	1,368,536.040	
BRT APARTMENTS CORP	4,006.000	74,711.900	
CAMDEN PROPERTY TRUST	45,592.000	4,492,179.760	
CARETRUST REIT INC	50,892.000	1,120,641.840	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10,705.000	269,444.850	
CENTERSPACE	6,258.000	345,566.760	
CHATHAM LODGING TRUST	23,615.000	255,750.450	
CITY OFFICE REIT INC	17,231.000	110,278.400	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	26,650.640	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	103,063.000	589,520.360	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,042.000	259,585.700	
COPT DEFENCE PROPERTIES	48,114.000	1,232,199.540	
COUSINS PROPERTIES INC	65,875.000	1,619,866.250	
CTO REALTY GROUTH INC	9,356.000	159,800.480	
CUBESMART	96,017.000	4,375,494.690	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	93,836.000	887,688.560	
DIGITAL REALTY TRUST INC	129,633.000	17,698,793.490	

		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	89,231.000	271,262.240	
		DOUGLAS EMMETT INC	71,171.000	1,030,556.080	
		EAST GROUP	19,767.000	3,614,791.290	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	40,105.000	545,829.050	
		ELME COMMUNITIES	37,307.000	542,816.850	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	55,519.000	554,634.810	
		EPR PROPERTIES	31,964.000	1,527,879.200	
		EQUINIX INC	40,201.000	32,337,282.390	
		EQUITY COMMONWEALTH	45,776.000	894,463.040	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	79,641.000	5,583,630.510	
		EQUITY RESIDENTIAL	147,794.000	9,120,367.740	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	66,274.000	1,728,425.920	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,437.000	6,801,083.560	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	90,420.000	14,181,472.800	
		FARMLAND PARTNERS INC	20,744.000	234,822.080	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	31,328.000	3,234,616.000	
		FIRST INDUSTRIAL RT	56,301.000	3,010,977.480	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	38,602.000	973,542.440	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,375.000	121,502.500	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	114,094.000	5,393,223.380	
		GETTY REALTY CORP	19,860.000	579,117.600	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	18,651.000	249,363.870	
		GLADSTONE LAND CORP	16,125.000	226,717.500	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,662.000	283,950.300	
		GLOBAL NET LEASE INC	87,053.000	867,918.410	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	165,299.000	2,896,038.480	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	233,625.000	4,665,491.250	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	45,088.000	1,058,215.360	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	301,232.000	5,946,319.680	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	52,743.000	494,201.910	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	96,261.000	1,447,765.440	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	122,039.740	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	11,985.000	1,130,904.600	

INVENTRUST PROPERTIES CORP	30,243.000	763,635.750	
INVITATION HOMES INC	246,007.000	8,406,059.190	
IRON MOUNTAIN INC	124,869.000	8,388,699.420	
JBG SMITH PROPERTIES	37,127.000	639,326.940	
KILROY REALTY CORP	45,330.000	1,883,008.200	
KIMCO REALTY	284,187.000	5,956,559.520	
KITE REALTY GROUP TRUST	94,287.000	2,112,971.670	
LTC PROPERTIES INC	17,897.000	579,504.860	
LXP INDUSTRIAL TRUST	125,109.000	1,217,310.570	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	256,205.000	932,586.200	
MID AMERICA	49,879.000	6,612,957.820	
NATIONAL HEALTH INVS INC	18,525.000	1,016,281.500	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	33,071.000	1,301,674.560	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	5,706.000	99,284.400	
NETSTREIT CORP	31,405.000	584,761.100	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	15,002.000	106,514.200	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	9,758.000	321,330.940	
NNN REIT INC	77,613.000	3,330,373.830	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23,664.000	146,716.800	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	104,316.000	3,179,551.680	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,764.000	169,332.840	
ORION OFFICE REIT INC	20,368.000	112,227.680	
PARAMOUNT GROUP INC	75,433.000	370,376.030	
PARK HOTELS & RESORTS INC	92,474.000	1,503,627.240	
PEAKSTONE REALTY TRUST	16,780.000	280,561.600	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	52,194.000	817,358.040	
PHILLIPS EDISON & CO INC	51,685.000	1,826,547.900	
PHYSICIANS REALTY TRUST	102,067.000	1,350,346.410	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	52,948.000	392,874.160	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,197.000	357,585.410	
POSTAL REALTY TRUST INC	6,866.000	97,771.840	
PROLOGIS INC	395,718.000	52,848,138.900	
PUBLIC STORAGE	67,747.000	20,000,269.340	
REALTY INCOME CORP	309,878.000	18,316,888.580	
REGENCY CENTERS CORP	70,156.000	4,522,255.760	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	54,625.000	764,750.000	

	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	90,171.000	5,056,789.680	
	RLJ LODGING TRUST	68,352.000	795,617.280	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25,914.000	2,897,962.620	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	101,334.000	1,414,622.640	
	SAFEHOLD INC	18,989.000	425,543.490	
	SAUL CENTERS INC	6,050.000	236,373.500	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	70,553.000	582,767.780	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	139,657.000	20,205,574.760	
	SITE CENTERS CORP	76,822.000	1,039,401.660	
	SL GREEN	27,556.000	1,273,087.200	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	60,818.000	2,738,634.540	
	STAG INDUSTRIAL INC	77,411.000	2,998,128.030	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	46,872.000	309,823.920	
	SUN COMMUNITIES INC	53,202.000	7,232,811.900	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	88,237.000	958,253.820	
	TANGER INC	45,065.000	1,232,978.400	
	TERRENO REALTY CORP	36,075.000	2,278,497.000	
	THE MACERICH COMPANY	93,044.000	1,461,721.240	
	UDR INC	129,254.000	4,940,087.880	
	UMH PROPERTIES INC	27,937.000	441,404.600	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,978.000	248,625.020	
	URBAN EDGE PROPERTIES	52,560.000	948,708.000	
	VENTAS INC	172,088.000	8,372,081.200	
	VERIS RESIDENTIAL INC	34,044.000	520,532.760	
	VICI PROPERTIES INC	442,746.000	13,950,926.460	
	VORNADO REALTY TRUST	68,678.000	1,940,153.500	
	WELLTOWER INC	236,943.000	21,497,838.390	
	WHITESTONE REIT	21,086.000	244,175.880	
	WP CAREY INC	93,454.000	6,236,185.420	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	46,358.000	613,316.340	
アメリカ・ドル　小計		9,591,263.000	456,336,749.950 (66,465,447,629)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	184,841.000	94,268.910	
	AEW UK REIT PLC	78,980.000	76,136.720	
	ASSURA PLC	1,261,651.000	581,621.110	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	294,915.000	206,735.410	
	BIG YELLOW GROUP PLC	84,625.000	979,957.500	
	BRITISH LAND CO PLC	406,587.000	1,608,864.750	
	CLS HOLDINGS PLC	45,585.000	44,582.130	

	CUSTODIAN REIT PLC	191,703.000	164,097.760	
	DERWENT LONDON PLC	48,486.000	1,104,511.080	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	265,420.000	254,272.360	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	106,005.000	433,984.470	
	HAMMERSON PLC	1,642,864.000	453,430.460	
	HELICAL PLC	48,089.000	110,604.700	
	HOME REIT PLC	286,621.000	0.000	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	169,602.000	149,249.760	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	320,349.000	2,211,689.490	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	147,597.000	93,281.300	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	460,646.000	848,049.280	
	LXI REIT PLC	730,734.000	752,656.020	
	NEWRIVER REIT PLC	151,095.000	126,768.700	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	239,715.000	162,526.770	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	567,154.000	576,228.460	
	PRS REIT PLC/THE	210,972.000	174,473.840	
	REGIONAL REIT LTD	236,558.000	78,064.140	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	93,759.000	795,076.320	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	203,492.000	89,129.490	
	SEGRO PLC	524,579.000	4,571,181.400	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	828,244.000	1,111,503.440	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	520,592.000	435,735.500	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	262,409.000	220,948.370	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	173,559.000	105,870.990	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	823,510.000	1,367,850.110	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	354,973.000	215,468.610	
	UNITE GROUP PLC	168,755.000	1,748,301.800	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	199,551.000	243,053.110	
	WAREHOUSE REIT PLC	182,285.000	158,405.660	
	WORKSPACE GROUP PLC	58,577.000	313,679.830	
イギリス・ポンド　小計		12,806,119.000	22,662,259.750 (4,207,701,768)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314,331.000	544,735.620	
	REIT 1 LTD	80,666.000	1,373,741.980	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	95,105.000	767,497.350	

イスラエル・シュケル　小計		490,102.000	2,685,974.950 (104,520,418)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	26,739.000	557,775.540	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,895.000	146,696.500	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,117.000	690,991.100	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,104.000	126,665.520	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	47,348.610	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	35,412.000	1,662,239.280	
	CHOICE PROPERTIES REIT	68,637.000	973,272.660	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	23,112.000	317,096.640	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,105.000	324,722.450	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	58,271.000	796,564.570	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	8,533.000	92,668.380	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	43,252.000	663,918.200	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,365.000	1,037,658.600	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	54,790.000	543,516.800	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	31,365.000	410,881.500	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,462.000	449,366.940	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,341.000	150,670.330	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,705.000	131,619.600	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	120,265.600	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	51,343.000	265,956.740	
	PRIMARIS REIT	18,222.000	249,823.620	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,769.000	81,210.350	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	63,044.000	1,178,922.800	
	SLATE GROCERY REIT	11,264.000	139,448.320	
	SMARTCENTRES REIT	29,198.000	739,001.380	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	3,727.000	36,338.250	
カナダ・ドル　小計		690,650.000	11,934,640.280 (1,299,562,980)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	358,594.000	410,590.130	

	GOODMAN PROPERTY TRUST	453,156.000	1,017,335.220	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	665,928.000	572,698.080	
	PRECINCT PROPERTIES	584,851.000	733,988.000	
ニュージーランド・ドル　小計		2,062,529.000	2,734,611.430 (248,384,756)	
ユーロ	AEDIFICA	20,156.000	1,239,594.000	
	ALTAREA	2,084.000	175,056.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	15,092.000	206,458.560	
	CARMILA SA	24,554.000	393,846.160	
	COFINIMMO SA	15,846.000	1,107,635.400	
	COVIVIO	21,151.000	979,714.320	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18,426.000	421,586.880	
	GECINA SA	21,871.000	2,327,074.400	
	HAMBORNER REIT AG	31,150.000	218,050.000	
	ICADE	13,143.000	446,862.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,555.000	46,865.400	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	122,692.000	745,967.360	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	12,768.000	264,297.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	195,526.000	223,681.740	
	KLEPIERRE	82,909.000	2,033,757.770	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22,313.000	143,026.330	
	MERCIALYS	39,645.000	401,603.850	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	142,055.000	1,378,643.770	
	MONTEA SCA	6,423.000	550,451.100	
	NSI NV	7,519.000	142,861.000	
	RETAIL ESTATES	5,024.000	318,521.600	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	13,273.000	550,232.210	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	43,282.000	2,863,537.120	
	VASTNED RETAIL	7,728.000	158,810.400	
	WAREHOUSES DE PAUW	75,013.000	2,059,856.980	
	WERELDHAVE NV	18,282.000	267,648.480	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,423.000	357,161.250	
ユーロ　小計		1,010,903.000	20,022,801.680 (3,199,843,936)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	26,312.000	84,461,520.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	69,322.000	253,718,520.000	
	JR REIT XXVII	65,671.000	271,877,940.000	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	22,542.000	115,640,460.000	
	LOTTE REIT CO LTD	48,275.000	149,169,750.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	20,887.000	69,762,580.000	

		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	33,139.000	219,711,570.000	
		SK REITS CO LTD	48,785.000	191,237,200.000	
	韓国・ウォン　小計		334,933.000	1,355,579,540.000 (150,062,655)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	814,070.000	1,799,094.700	
		LINK REIT	1,094,920.000	46,534,100.000	
		PROSPERITY REIT	538,000.000	720,920.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	445,000.000	912,250.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	908,000.000	1,026,040.000	
	香港・ドル　小計		3,799,990.000	50,992,404.700 (949,988,500)	
投資証券　合計			30,786,489	76,625,512,642 (76,625,512,642)	
合計				85,280,070,893 (85,280,070,893)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券　5銘柄 投資証券　135銘柄	0.08 －	－ 77.35	78.01
イギリス・ポンド	投資証券　38銘柄	－	4.90	4.93
イスラエル・シュケル	投資証券　3銘柄	－	0.12	0.12
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券　31銘柄	6.62	－	6.67
カナダ・ドル	投資証券　26銘柄	－	1.51	1.52
シンガポール・ドル	投資信託受益証券　22銘柄	3.27	－	3.30
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 投資証券　27銘柄	0.03 －	－ 3.72	3.79
韓国・ウォン	投資証券　8銘柄	－	0.17	0.18
香港・ドル	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　5銘柄	0.07 －	－ 1.11	1.18

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間（2024年1月12日から2024年7月11日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド　エボリューション】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 2024年1月11日現在	第15期中間計算期間末 2024年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,445,283	53,903,564
親投資信託受益証券	1,917,649,475	2,335,735,401
流動資産合計	1,957,094,758	2,389,638,965
資産合計	1,957,094,758	2,389,638,965
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,873,097	1,853,516
未払受託者報酬	417,826	462,339
未払委託者報酬	5,327,924	5,895,327
その他未払費用	37,089	41,060
流動負債合計	17,655,936	8,252,242
負債合計	17,655,936	8,252,242
純資産の部		
元本等		
元本	561,533,016	556,835,371
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,377,905,806	1,824,551,352
（分配準備積立金）	763,393,935	727,623,120
元本等合計	1,939,438,822	2,381,386,723
純資産合計	1,939,438,822	2,381,386,723
負債純資産合計	1,957,094,758	2,389,638,965

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自　2023年1月12日 至　2023年7月11日	第15期中間計算期間 自　2024年1月12日 至　2024年7月11日
営業収益		
受取利息	124	8,950
有価証券売買等損益	192,863,760	462,953,926
営業収益合計	192,863,884	462,962,876
営業費用		
支払利息	5,477	389
受託者報酬	372,390	462,339
委託者報酬	4,748,429	5,895,327
その他費用	33,059	41,060
営業費用合計	5,159,355	6,399,115
営業利益又は営業損失（△）	187,704,529	456,563,761
経常利益又は経常損失（△）	187,704,529	456,563,761
中間純利益又は中間純損失（△）	187,704,529	456,563,761
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	3,390,116	5,741,942
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,058,040,215	1,377,905,806
剰余金増加額又は欠損金減少額	46,344,292	61,336,828
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	46,344,292	61,336,828
剰余金減少額又は欠損金増加額	43,472,541	65,513,101
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	43,472,541	65,513,101
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,245,226,379	1,824,551,352

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第15期中間計算期間 自　2024年1月12日 至　2024年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第14期 2024年1月11日現在	第15期中間計算期間末 2024年7月11日現在
１．　期首元本額	569,758,557円	561,533,016円
期中追加設定元本額	46,696,679円	21,975,170円
期中一部解約元本額	54,922,220円	26,672,815円
２．　受益権の総数	561,533,016口	556,835,371口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 2024年1月11日現在	第15期中間計算期間末 2024年7月11日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第14期 2024年1月11日現在	第15期中間計算期間末 2024年7月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4538円 (34,538円)	4.2766円 (42,766円)

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年7月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	19,059,735,560
株式	616,533,357,860
派生商品評価勘定	938,230,400
未収入金	39,567,700
未収配当金	705,751,009
差入委託証拠金	880,115,895
流動資産合計	638,156,758,424
資産合計	638,156,758,424
負債の部	
流動負債	
前受金	888,360,000
未払解約金	1,846,864,000
流動負債合計	2,735,224,000
負債合計	2,735,224,000
純資産の部	
元本等	
元本	122,888,680,254
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	512,532,854,170
元本等合計	635,421,534,424
純資産合計	635,421,534,424
負債純資産合計	638,156,758,424

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	122,361,611,329円
同期中追加設定元本額	16,632,524,560円
同期中一部解約元本額	16,105,455,635円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM　ＴＯＰＩＸオープン	2,390,087,865円
たわらノーロード　国内株式＜ラップ専用＞	5,785,499,462円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	32,848,320,935円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	4,397,175,990円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,958,569円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	7,816,793円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	18,939,455円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	25,971,845円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	24,226,143円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,153,893円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	2,659,865,923円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,820,886,945円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	45,089,057円
たわらノーロード　バランス（標準型）	356,164,639円
たわらノーロード　バランス（積極型）	653,248,468円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	2,266,413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）	134,781,854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）	410,483,640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）	372,881,810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）	559,738,998円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	243,426円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,101,101円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	26,624,871円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,259,584円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	14,949,678円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,163,575,180円
Ｏｎｅグローバルバランス	73,765,273円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	837,729,984円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,202,950,685円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,810,429,535円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	239,326,118円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	850,289,739円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,015,232,446円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	26,070,549円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	977,266,719円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	12,880,508円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	251,242,626円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	326,233,876円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	567,559,742円
投資のソムリエ	7,736,476,481円
クルーズコントロール	289,712,998円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	861,727,377円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	362,586,445円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,326,527,938円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	569,989,337円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,711,874,580円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	86,195,832円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	44,452,487円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,327,370円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	187,958,644円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	550,405,813円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	290,489,129円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	209,928,388円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	95,248,100円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	47,648,979円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	29,932,123円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	641,322,434円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	7,355,549円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,004,820円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	30,102,952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）	10,085,111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）	10,235,514円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,374,895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）	6,009,190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）	188,191円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	25,723,977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）	103,596,591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）	7,091,633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）	74,146,572円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	346,171,924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）	21,503,087円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２４－０５（適格機関投資家限定）	348,588,445円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	129,850,854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）	3,481,652円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,648,620円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	40,081,700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）	16,778,409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）	4,334,968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）	32,377,121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）	61,254,030円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,451,173円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,313,010円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,868,589円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	76,436円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	518,912円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,037,689円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	237,243,342円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	362,013,605円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,131,189,790円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	9,480,442円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	12,717,715円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	122,747,545円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	23,441,291円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,212円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	117,779,449円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,998,315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）	30,947,238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）	70,409,253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）	118,815,637円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,540,014円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,856,508円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	24,768,482円
コア資産形成ファンド	11,700,858円
ＭＨＡＭトピックスファンド	771,274,565円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	44,206,377円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	2,798,515,218円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,438,702,360円
計	122,888,680,254円

２．　受益権の総数	122,888,680,254口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2024年7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	17,221,365,000	－	18,159,800,000	938,435,000
合計	17,221,365,000	－	18,159,800,000	938,435,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年7月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.1707円 (51,707円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	6,313,277,042
コール・ローン	2,718,304,563
株式	1,647,939,118,102
投資信託受益証券	2,399,514,104
投資証券	27,767,970,337
派生商品評価勘定	447,800,725
未収入金	57,186,414
未収配当金	1,160,500,347
差入委託証拠金	13,431,244,062
流動資産合計	1,702,234,915,696
資産合計	1,702,234,915,696
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,261,583
未払金	60,038,387
未払解約金	1,511,271,000
流動負債合計	1,576,570,970
負債合計	1,576,570,970
純資産の部	
元本等	
元本	169,125,591,156
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,531,532,753,570
元本等合計	1,700,658,344,726
純資産合計	1,700,658,344,726
負債純資産合計	1,702,234,915,696

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	160,807,419,421円
同期中追加設定元本額	20,850,651,636円
同期中一部解約元本額	12,532,479,901円

元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,786,814,481円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,326,759円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,348,704円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	16,058,553円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	17,590,613円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	19,677,824円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	11,150,523円
たわらノーロード　先進国株式	65,154,608,653円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,681,276,401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）	70,139,754円
たわらノーロード　バランス（標準型）	711,977,424円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,035,656,067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）	39,104,327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）	228,080,989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）	248,623,158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）	455,106,289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）	223,342円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	13,524,867円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,504,651円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	14,241,371円
たわらノーロード　全世界株式	4,713,223,458円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	58,340,550,430円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	3,624,046,455円
Ｏｎｅグローバルバランス	37,488,691円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	114,533,318円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	695,225,687円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	955,326,040円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	61,391,912円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	188,107,574円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	207,351,904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）	129,457,591円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	169,369,244円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	296,561,969円
投資のソムリエ	7,559,051,391円
クルーズコントロール	79,514,101円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	836,364,730円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	185,639,140円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	321,104,265円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	605,571,370円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,817,914,503円
ワールドアセットバランス（基本コース）	80,909,672円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	235,434,236円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	59,088,402円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	30,471,122円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,660,084円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	182,488,963円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	141,102,623円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	468,334,850円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	108,108,498円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	66,960,165円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	32,662,704円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	20,516,212円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	163,659,938円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	5,030,858円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	28,671,733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）	7,702,222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）	7,730,896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）	27,473,602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）	4,606,089円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	236,047円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	19,579,460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）	12,574,663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）	5,378,624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）	49,649,435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）	22,210,044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）	323,596,758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）	34,009,488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）	971,567,301円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,040,757,502円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	126,043,128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）	334,992円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,490,767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）	12,764,035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）	4,250,347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）	16,442,784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）	31,105,961円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,244,899円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,096,057円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	727,975円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,032円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	263,486円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,552,306円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	80,295,215円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	160,864,281円

ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	574,488,282円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	24,296,786円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	19,486,538円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	124,554,861円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	3,927,619円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	115,385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）	39,870,314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）	3,555,175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）	15,717,802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）	23,838,992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）	60,342,065円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	11,799,046円
コア資産形成ファンド	5,627,650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＞	2,084,428,375円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	130,350,216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＞	949,639,486円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,330,095,505円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,005,942,374円
計	169,125,591,156円
２．　受益権の総数	169,125,591,156口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年7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				
買建	2,046,655,140	－	2,048,735,733	2,080,593
アメリカ・ドル	1,596,938,200	－	1,597,957,360	1,019,160
イギリス・ポンド	98,964,258	－	99,356,596	392,338
オーストラリア・ドル	47,552,255	－	47,665,868	113,613
カナダ・ドル	70,893,896	－	70,972,360	78,464
ユーロ	232,306,531	－	232,783,549	477,018
合計	2,046,655,140	－	2,048,735,733	2,080,593

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2024年7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	22,878,628,149	－	23,319,086,698	440,458,549
合計	22,878,628,149	－	23,319,086,698	440,458,549

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年7月11日現在
1口当たり純資産額	10.0556円
（1万口当たり純資産額）	(100,556円)

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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,160,259,527
コール・ローン	192,474,459
株式	100,266,758,221
投資信託受益証券	626,290,569
投資証券	90,697,230
派生商品評価勘定	159,806,146
未収入金	1,027,587
未収配当金	569,095,562
差入委託証拠金	2,086,865,509
流動資産合計	106,153,274,810
資産合計	106,153,274,810
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,097
未払金	122,050
未払解約金	16,620,000
流動負債合計	16,753,147
負債合計	16,753,147
純資産の部	
元本等	
元本	54,421,229,418
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	51,715,292,245
元本等合計	106,136,521,663
純資産合計	106,136,521,663
負債純資産合計	106,153,274,810

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	54,509,988,915円
同期中追加設定元本額	12,470,576,906円
同期中一部解約元本額	12,559,336,403円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	10,436,039,981円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ専用＞	5,485,712,495円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,049,103円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,814,469円

ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	24,813,185円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	27,164,507円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	30,418,085円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	17,231,960円
たわらノーロード　新興国株式	14,087,228,071円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	265,896,496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）	29,801,049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）	265,874,669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）	97,905,025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）	122,772,955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）	220,926,840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）	8,762,987円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,120,038円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,369,646円
たわらノーロード　全世界株式	2,931,494,398円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	1,484,009,307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）	342,030,118円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	597,016,450円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	1,152,639,552円
投資のソムリエ	4,002,432,418円
クルーズコントロール	404,503,490円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	433,929,268円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	487,942,856円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	754,713,738円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,264,382,608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）	1,264,883,932円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	157,137,713円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	81,038,830円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	7,051,837円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	94,878,588円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	258,141,255円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	279,013,332円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	112,684,039円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	86,864,905円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	54,556,393円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	13,384,905円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	14,861,482円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	65,416,688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）	2,191,798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）	103,457,774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）	61,857,906円
計	54,421,229,418円
２．　受益権の総数	54,421,229,418口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年7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	218,508,616	－	218,519,713	△11,097
アメリカ・ドル	217,675,200	－	217,685,033	△9,833
ブラジル・レアル	833,416	－	834,680	△1,264
買建	75,284,916	－	75,382,283	97,367
アメリカ・ドル	75,284,916	－	75,382,283	97,367
合計	293,793,532	－	293,901,996	86,270

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2024年7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	4,742,870,933	－	4,902,579,712	159,708,779
合計	4,742,870,933	－	4,902,579,712	159,708,779

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.9503円
（1万口当たり純資産額）	(19,503円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年7月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,396,489,819
国債証券	467,770,271,450
地方債証券	26,667,044,365
特殊債券	26,579,203,128
社債券	21,834,630,400
未収利息	707,175,800
前払費用	208,969,067
流動資産合計	545,163,784,029
資産合計	545,163,784,029
負債の部	
流動負債	
未払解約金	95,117,000
流動負債合計	95,117,000
負債合計	95,117,000
純資産の部	
元本等	
元本	453,279,566,821
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	91,789,100,208
元本等合計	545,068,667,029
純資産合計	545,068,667,029
負債純資産合計	545,163,784,029

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	428,394,158,975円
同期中追加設定元本額	211,142,535,653円
同期中一部解約元本額	186,257,127,807円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	30,722,818,887円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	49,680,795円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	91,497,323円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	52,327,887円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	661,076,252円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	282,371,982円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	36,336,713円
たわらノーロード　国内債券	19,489,995,039円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	7,179,334,992円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,688,390,514円
たわらノーロード　バランス（標準型）	3,551,376,182円
たわらノーロード　バランス（積極型）	531,763,776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）	215,834,695円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	2,494,884,549円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	2,991,628,840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）	910,069,753円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	43,920,714円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	22,198,036円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	198,366,750円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	7,504,199円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	62,284円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	12,642,044,669円
Ｏｎｅグローバルバランス	201,068,431円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	11,783,695,724円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	17,278,585,929円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	8,313,342,871円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,549,133,727円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,909,035,014円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	577,069,320円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	94,093,897円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	3,527,854,747円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	6,436,914円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	5,784,285,727円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,603,595,349円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	569,216,433円
投資のソムリエ	83,906,347,804円
クルーズコントロール	1,145,496,062円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	9,159,654,706円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	8,380,648,525円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	3,035,220,836円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	11,175,782,233円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	33,482,271,664円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	355,481,749円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	183,319,141円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	104,528,069円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,993,089,160円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,925,508,380円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,587,975,500円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	6,580,094,470円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	487,605,828円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	196,502,362円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	123,430,813円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	3,282,547,892円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	30,551,912円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	180,761,029円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	1,200,801,753円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	1,205,035,474円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,186,328,855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）	721,173,423円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	1,190,033,780円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	3,045,585,201円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	2,107,160,698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）	832,472,006円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	2,146,897,132円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	1,323,331,368円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	8,905,226,911円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,068,557,042円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	1,382,660,769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）	206,062,541円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	279,030,885円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	4,064,184,282円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	4,050,598,427円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	3,998,262,930円

インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,992,615,713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）	46,949,352円
ＡＭＯｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	817,696,087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）	159,744,247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）	100,645,071円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,523,912円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,441,816円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,492,409円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	419,574円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,200,602円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,561,976円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,601,877,965円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,232,865,822円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,650,455,277円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	58,596,399円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	131,025,324円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,514,260,117円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	96,004,246円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	618,909円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,291,399,475円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,776,957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）	254,544,316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）	385,972,423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）	814,351,676円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	209,350,796円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	56,179,562円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	387,569,601円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	293,254,423円
コア資産形成ファンド	138,742,674円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ専用＞	17,240,265,427円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	33,226,360,796円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	21,974,823,370円
ＭＨＡＭ動的パッケージ４資産ファンド［適格機関投資家限定］	156,616,234円
計	453,279,566,821円
２．　受益権の総数	453,279,566,821口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年7月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2025円 (12,025円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	710,927,899
コール・ローン	822,894,257
国債証券	271,660,715,049
派生商品評価勘定	2,040
未収入金	599,529,531
未収利息	1,976,585,871
前払費用	257,093,954
流動資産合計	276,027,748,601
資産合計	276,027,748,601
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,845
未払金	319,708,822
未払解約金	35,001,000
流動負債合計	354,733,667
負債合計	354,733,667
純資産の部	
元本等	
元本	108,939,825,373
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	166,733,189,561
元本等合計	275,673,014,934
純資産合計	275,673,014,934
負債純資産合計	276,027,748,601

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	107,965,110,236円
同期中追加設定元本額	21,388,693,186円
同期中一部解約元本額	20,413,978,049円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,354,593,230円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,477,145円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,887,977円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	30,095,797円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	19,580,239円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	30,647,055円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	20,899,630円
たわらノーロード　先進国債券	22,066,590,472円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,573,409,539円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	68,492,758円
たわらノーロード　バランス（標準型）	412,257,408円
たわらノーロード　バランス（積極型）	101,969,942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）	19,319,862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）	1,031,125,538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）	1,923,498,168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）	1,016,256,178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）	582,405,384円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,208,457円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	12,670,480円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	184,706,726円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	28,950,376円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	26,852,956円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	7,023,388,413円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	2,019,037,002円
Ｏｎｅグローバルバランス	104,598,463円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	709,376,271円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,430,100,443円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,952,485,292円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	357,908,619円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	829,224,698円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	808,215,286円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	25,663,517円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	961,381,549円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	17,942,671円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	154,157,168円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	160,868,965円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	275,311,423円
クルーズコントロール	894,367,559円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	224,640,619円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,053,117,574円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	823,522,799円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	170,358,103円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	636,180,672円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	4,980,138円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	54,072,707円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	907,776,982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）	431,869,832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）	433,592,012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）	370,069,558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）	259,924,090円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	1,097,025,601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）	295,646,031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）	299,467,397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）	411,388,044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）	638,437,301円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	5,637,086,624円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	1,374,652,465円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,509,531,098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）	69,602,200円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,909,827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）	709,672,546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）	308,094,392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）	194,179,407円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,336,682円

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,454,022円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,683,458円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,916円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,543,096円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,038,361円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,097,136,193円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,165,771,487円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,241,167,585円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	47,301,106円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	88,540,084円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	978,483,977円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	170,747,219円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	149,751円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	155,539,231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）	186,029,158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）	314,004,483円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	30,818,414円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	52,571,556円
コア資産形成ファンド	24,173,219円
たわらノーロード　外国債券（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	3,624,670,831円
たわらノーロード　外国債券（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	11,683,061,028円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	5,757,938,684円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	5,083,349,592円
計	108,939,825,373円
２．　受益権の総数	108,939,825,373口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年7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	560,000,000	－	560,021,805	△21,805
アメリカ・ドル	353,214,000	－	353,229,956	△15,956
イギリス・ポンド	32,589,000	－	32,591,744	△2,744
オフショア・人民元	37,682,000	－	37,679,960	2,040
ユーロ	136,515,000	－	136,520,145	△5,145
合計	560,000,000	－	560,021,805	△21,805

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.5305円
（1万口当たり純資産額）	(25,305円)

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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	694,941,400
コール・ローン	186,910,417
国債証券	127,392,909,000
未収利息	1,630,227,481
前払費用	274,537,210
流動資産合計	130,179,525,508
資産合計	130,179,525,508
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,486
未払解約金	11,991,000
流動負債合計	12,000,486
負債合計	12,000,486
純資産の部	
元本等	
元本	50,942,916,967
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	79,224,608,055
元本等合計	130,167,525,022
純資産合計	130,167,525,022
負債純資産合計	130,179,525,508

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,108,629,278円
同期中追加設定元本額	18,974,235,963円
同期中一部解約元本額	11,139,948,274円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,538,012,090円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	181,102,068円
たわらノーロード　バランス（標準型）	613,372,883円
たわらノーロード　バランス（積極型）	302,881,342円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	477,096円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	4,750,869円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	65,233,108円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	7,157,004円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,318,004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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	255,341,487円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	409,557,576円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	839,978,604円
投資のソムリエ	11,138,206,681円
クルーズコントロール	296,492,824円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,209,115,861円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	363,954,282円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,307,581,568円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,926,353,281円
ワールドアセットバランス（基本コース）	292,343,538円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	867,847,463円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	88,458,898円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	45,629,810円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	12,218,630円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	263,818,129円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	760,695,375円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	211,104,397円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	96,802,330円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	48,867,020円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	29,911,242円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	7,577,507円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,969,385円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	14,750,726円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	19,620,966,528円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	182,337,115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）	948,938,111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）	622,617,672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）	6,216,935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）	76,800,519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）	45,845,928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）	2,167,972,117円
計	50,942,916,967円
２．　受益権の総数	50,942,916,967口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年7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	210,000,000	－	210,009,486	△9,486

アメリカ・ドル	210,000,000	－	210,009,486	△9,486
合計	210,000,000	－	210,009,486	△9,486

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.5552円
（1万口当たり純資産額）	(25,552円)

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年7月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,140,302,417
投資証券	164,243,357,000
派生商品評価勘定	18,970,480
未収入金	520,738,003
未収配当金	1,681,715,807
前払金	2,142,750
差入委託証拠金	264,655,868
流動資産合計	169,871,882,325
資産合計	169,871,882,325
負債の部	
流動負債	
未払解約金	167,451,000
流動負債合計	167,451,000
負債合計	167,451,000
純資産の部	
元本等	
元本	74,375,234,055
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	95,329,197,270
元本等合計	169,704,431,325
純資産合計	169,704,431,325
負債純資産合計	169,871,882,325

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	82,686,701,762円
同期中追加設定元本額	13,416,681,280円
同期中一部解約元本額	21,728,148,987円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	192,112円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	911,876円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	2,254,837円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,542,183円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	2,820,072円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,551,552円
たわらノーロード　国内リート	6,009,276,336円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,953,805,957円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	50,090,971円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,142,415,631円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,466,705,987円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	418,050,041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）	1,053,052,211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）	809,383,571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）	971,952,470円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	4,782,725円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	93,912,304円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	16,984,180円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	30,420,974円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,646,122円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	473,314,451円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	4,539,059円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	152,407,293円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	236,914,240円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	555,306,569円
投資のソムリエ	1,617,803,438円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	175,592,309円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	225,908,401円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	512,471,480円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,539,782,687円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	12,313,425円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	6,346,452円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,792,192円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	38,383,584円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	423,557,216円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	134,590,634円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	14,077,544円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	6,806,031円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	4,271,230円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,117,036円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	61,256,722円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	79,538,155円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（隔月決算型）	16,163,543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）	51,063,861円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	169,553,372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）	51,451,100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）	93,430,455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）	30,936,738円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	201,439,141円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	82,907,926円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）２１－０３（適格機関投資家限定）	199,986,573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）	112,116,826円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	130,077,552円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	42,575,122円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０７（適格機関投資家限定）	70,134,077円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０８（適格機関投資家限定）	48,988,137円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	82,857,437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）	35,750,832円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０９（適格機関投資家限定）	48,851,477円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－１２（適格機関投資家限定）	70,790,495円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	334,021,063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）	100,997,102円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）２４－０４（適格機関投資家限定）	133,248,553円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２４－０５（適格機関投資家限定）	336,667,703円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,086,039,681円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	26,345,852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）	19,757,111円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	432,163,523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）	85,106,821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）	938,185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）	125,726,810円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	6,866,614,167円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	31,084,136,991円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,599,496,480円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ専用＞	5,280,020,928円
計	74,375,234,055円
２．　受益権の総数	74,375,234,055口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2024年7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	4,856,185,750	－	4,875,470,500	19,284,750
合計	4,856,185,750	－	4,875,470,500	19,284,750

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.2817円
（1万口当たり純資産額）	(22,817円)

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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	216,819,512
コール・ローン	114,408,325
投資信託受益証券	9,636,299,674
投資証券	81,676,665,216
派生商品評価勘定	10,196,601
未収入金	1,444,366
未収配当金	356,815,224
差入委託証拠金	443,177,400
流動資産合計	92,455,826,318
資産合計	92,455,826,318
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	216
未払金	156,931,147
未払解約金	5,829,000
流動負債合計	162,760,363
負債合計	162,760,363
純資産の部	
元本等	
元本	43,172,831,262
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	49,120,234,693
元本等合計	92,293,065,955
純資産合計	92,293,065,955
負債純資産合計	92,455,826,318

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	44,985,698,714円
同期中追加設定元本額	8,398,331,551円
同期中一部解約元本額	10,211,199,003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＞	3,571,055,580円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,846,749円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,627,449円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	34,521,750円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	37,734,241円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	42,240,217円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,753,266円
たわらノーロード　先進国リート	15,394,580,937円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	127,602,314円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	241,948,348円

たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	4,289,543,043円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	27,062,049円
たわらノーロード　バランス（標準型）	614,077,443円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,458,600,487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）	533,024,778円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	665,972,132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）	1,199,632,426円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	8,688円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	39,627,111円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	12,422,159円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	37,826,520円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	2,319,701,441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	3,613,701,283円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	391,876,183円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	268,571,746円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	454,055,708円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,362,332,435円
ワールドアセットバランス（基本コース）	230,288,004円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	686,701,640円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	70,869,974円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	36,552,462円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,243,732円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	85,483,017円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,040,514,893円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	153,981,745円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	46,947,361円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	39,179,034円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	24,607,767円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	6,035,241円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	76,165,831円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	270,424,593円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	385,324,057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Ⅱ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	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）	59,203,791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）	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（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	1,984,806円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	37,013,879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）	93,407,812円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,233,285,862円
計	43,172,831,262円
２．　受益権の総数	43,172,831,262口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年7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				
買建	109,129,540	－	109,135,319	5,779
アメリカ・ドル	80,848,350	－	80,852,750	4,400
イギリス・ポンド	10,394,550	－	10,395,485	935
オーストラリア・ドル	13,090,620	－	13,090,404	△216
シンガポール・ドル	4,796,020	－	4,796,680	660
合計	109,129,540	－	109,135,319	5,779

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

不動産投信関連

種類	2024年7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	994,421,164	－	1,004,611,770	10,190,606
合計	994,421,164	－	1,004,611,770	10,190,606

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年7月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1378円 (21,378円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	2,213,916,281円
Ⅱ　負債総額	8,543,394円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,205,372,887円
Ⅳ　発行済数量	557,103,663口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9586円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	611,446,484,119円
Ⅱ　負債総額	2,460,255,850円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	608,986,228,269円
Ⅳ　発行済数量	123,451,717,316口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.9330円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,572,915,417,319円
Ⅱ　負債総額	571,282,992円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,572,344,134,327円
Ⅳ　発行済数量	170,578,328,547口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	9.2177円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	96,896,169,677円
Ⅱ　負債総額	134,231,443円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	96,761,938,234円
Ⅳ　発行済数量	54,539,381,293口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7742円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	552,933,392,787円
Ⅱ　負債総額	4,633,215,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	548,300,177,787円
Ⅳ　発行済数量	454,882,686,999口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2054円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	259,188,003,513円
Ⅱ　負債総額	106,048,001円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	259,081,955,512円
Ⅳ　発行済数量	107,528,300,768口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4094円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	**124,867,373,201円**
Ⅱ　負債総額	**1,010,156,563円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**123,857,216,638円**
Ⅳ　発行済数量	**51,027,145,601口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.4273円**

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	**171,969,279,682円**
Ⅱ　負債総額	**1,582,654,824円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**170,386,624,858円**
Ⅳ　発行済数量	**74,334,428,217口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.2922円**

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	**95,177,879,140円**
Ⅱ　負債総額	**600,661,788円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**94,577,217,352円**
Ⅳ　発行済数量	**44,718,351,523口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.1150円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2024年7月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2024年7月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

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

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,480,586,385,664
追加型株式投資信託	773	16,670,840,637,703
単位型公社債投資信託	21	31,003,186,015
単位型株式投資信託	196	1,062,795,195,927
合計	1,016	19,245,225,405,309

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		1,127		1,093
建物	※1	1,001	※1	918
器具備品	※1	118	※1	130
リース資産	※1	7	※1	5
建設仮勘定		-		39
無形固定資産		5,021		4,495
ソフトウエア		3,367		2,951
ソフトウエア仮勘定		1,651		1,543
電話加入権		2		0
投資その他の資産		9,768		8,935
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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

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

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

6. 収益及び費用の計上基準	**当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。** **(1) 委託者報酬** **委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年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	ソフトウエア仮勘定	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エ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エア仮勘定について、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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期（2023年3月31日現在）

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

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			
その他有価証券	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				
その他有価証券(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				
その他有価証券(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				
その他有価証券	－	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				
その他有価証券	－	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（その他有価証券）		
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 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
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 (2023年3月31日現在)	第39期 (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

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第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
合計	113,962百万円	121,507百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（持分法損益等）

当社は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種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

４【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

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

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（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
マネックス証券株式会社	13,195	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2024年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

名称	イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社
資本金の額	9,557.5万円（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)・運用報告書の送付
(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。
イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

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【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

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

・目論見書の使用開始日

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

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

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

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

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

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２４年3月１５日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　森　重　　俊　寛

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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド　エボリューションの２０２３年1月１２日から２０２４年1月１１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド　エボリューションの２０２４年1月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

２０２４年9月１３日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

中間監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド　エボリューションの２０２４年1月１２日から２０２４年7月１１日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド　エボリューションの２０２４年7月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（２０２４年1月１２日から２０２４年7月１１日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監

査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。